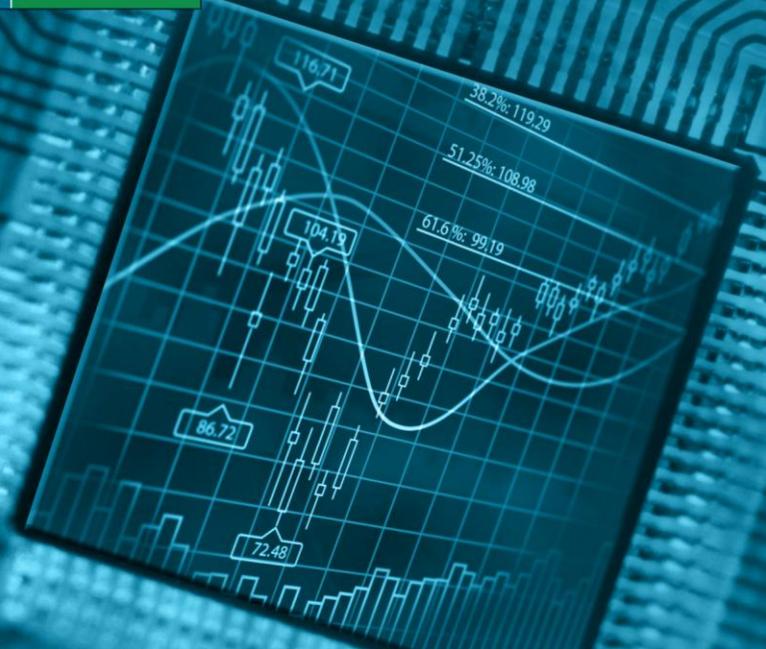




ROBOTRADING
ERFOLGREICH AUTOMATISIERT TRADEN

DAX

02



ANLEITUNG

**Anleitung für die Umsetzung von
Robotrading DAX (RTD)**

Inhaltsverzeichnis

Die Zielrendite liegt zwischen +25 % und +50 % pro Jahr	4
Performance von Robotrading DAX (Standardumsetzung)	5
Performance von Robotrading DAX (spekulative Umsetzung)	6
Einstellungen und Handelsinstrumente	7
So funktionieren CFDs.....	7
So konfigurieren Sie die Robotrading DAX-Handelsroboter	8
Robotrading DAX in der Standardumsetzung (ab 5.000 EUR)	8
Robotrading DAX in der spekulativen Umsetzung (ab 5.000 EUR)	9
So können Sie Einstellungen anpassen	9
Robotrading DAX (RTD) auf Konten mit weniger als 5.000 EUR Kapital	9
Für wen ist welche Umsetzung geeignet?	9
Die Robotrading DAX-Strategie einfach erklärt	10
Die Handelslogik unseres RTD-Basis-Roboters	10
Beispiel: Der RTD-Basis-Roboter im Einsatz	13
Die Handelslogik unseres RTD-Long-Roboters	14
Beispiel: Der RTD-Long-Roboter im Einsatz.....	15
Robotrading Kundenservice	17

Das Team



links:
Marius Müller
Chefentwickler

rechts:
Silvio Graß
Chefredakteur & Portfoliomanager

Anleitung für die Umsetzung von Robotrading DAX (RTD)

Lieber Trader,

herzlich willkommen bei unserer vollautomatisierten Handelsstrategie für den deutschen Leitindex DAX. Mit unserem Roboter können Sie den beliebtesten deutschen Index hochprofitabel handeln und Ihre Gewinnchancen an der Börse enorm vergrößern.

Robotrading DAX ist für den Einsatz zweier Handelsroboter speziell auf den DAX konzipiert worden (sogenannte Expert Advisor bzw. EAs). Diese Expert Advisor übernehmen dabei den alltäglichen Handel. Wie Sie diese installieren und einrichten, entnehmen Sie bitte der separaten „[Anleitung für die Installation und Einrichtung des Robotrading DAX-Handelsroboters](#)“.

Wir unterstützen Sie dabei mithilfe unserer Musterportfolios, sodass Sie mehr Zeit für die schönen Dinge des Lebens haben. Sie erhalten wöchentlich eine Zusammenfassung der letzten Trades und eine Erfolgsrechnung. Sollten Änderungen anstehen, informieren wir Sie per E-Mail. Aber keine Sorge, das passiert nur selten. In der Regel läuft bei Robotrading DAX alles vollautomatisch!

Damit Sie direkt loslegen können, haben wir für Sie diese Anleitung zur Umsetzung erstellt. Idealerweise haben Sie die Handelsroboter bereits gemäß der gesonderten Anleitung installiert. Alle Anleitungen und Videos sowie Links zum Download der Handelsroboter finden Sie auf unserer Internetseite: www.robotrading.de/dax/schnelleinstieg.

Unter [Schritt 6](#) finden Sie dort auch ein Video, in dem wir Ihnen die Umsetzung Schritt für Schritt demonstrieren. Sie werden sehen, es ist wirklich kinderleicht. Wenn Sie sich das Video angeschaut haben, dann benötigen Sie diese PDF-Anleitung im Prinzip nur noch um [die aktuelle Zusammenstellung unserer Musterportfolios](#) nachzuschlagen. Außer Sie möchten Details zu unserer Strategie erfahren, dann sollten Sie weiterlesen.

Wir wünschen Ihnen viel Erfolg, Ihr



Marius Müller
Chefentwickler

&



Silvio Graß
Chefredakteur und Portfoliomanager

P.S.: Robotrading DAX lässt sich mit dem „Rundum-Sorglos-Paket“ umsetzen. Falls Sie sich nicht mit der Materie beschäftigen möchten, schauen Sie sich bitte das Angebot „Rundum-Sorglos-Paket“ an. Auf Wunsch setzt ein Broker Robotrading DAX komplett für Sie um. Weitere Informationen finden Sie hier: www.robotrading.de/rsp

Die Zielrendite liegt zwischen +25 % und +50 % pro Jahr

Mit dem RTD erhalten Sie zwei Handelsroboter für den DAX mit optimalem Ertrags-Risiko-Verhältnis. Wir stellen Ihnen zudem zwei Einstellungsvorschläge zur Verfügung: Standard und Spekulativ. Diese können Sie 1:1 nachbilden. Selbstverständlich steht es Ihnen auch frei, den Spekulationsgrad durch eine Veränderung der Einstellungen selbstständig zu variieren (siehe Kapitel „Einstellungen und Handelsinstrumente“).

In der Standardumsetzung wurde im Backtest unter Live-Bedingungen pro Jahr seit 2012 durchschnittlich 30.90% Rendite erzielt. Wir rechnen mit einer Zielrendite von 25% im Jahr.

In der spekulativen Umsetzung wurde im Backtest unter Live-Bedingungen pro Jahr seit 2012 durchschnittlich 66,75% Rendite erzielt. Wir rechnen mit einer Zielrendite von 50% im Jahr.

Wir empfehlen eine Kontogröße von 5.000 € oder mehr. Sie können Robotrading DAX aber auch schon auf kleineren Konten ausprobieren. Die Verwendung des Rundum-Sorglos-Pakets ist ab einer Kontogröße von 2.000 € möglich. Wir haben hier eine Ausnahmeregel für Sie ausgehandelt, denn normalerweise bietet der Broker diesen kostenlosen Service erst ab 5.000 € an.

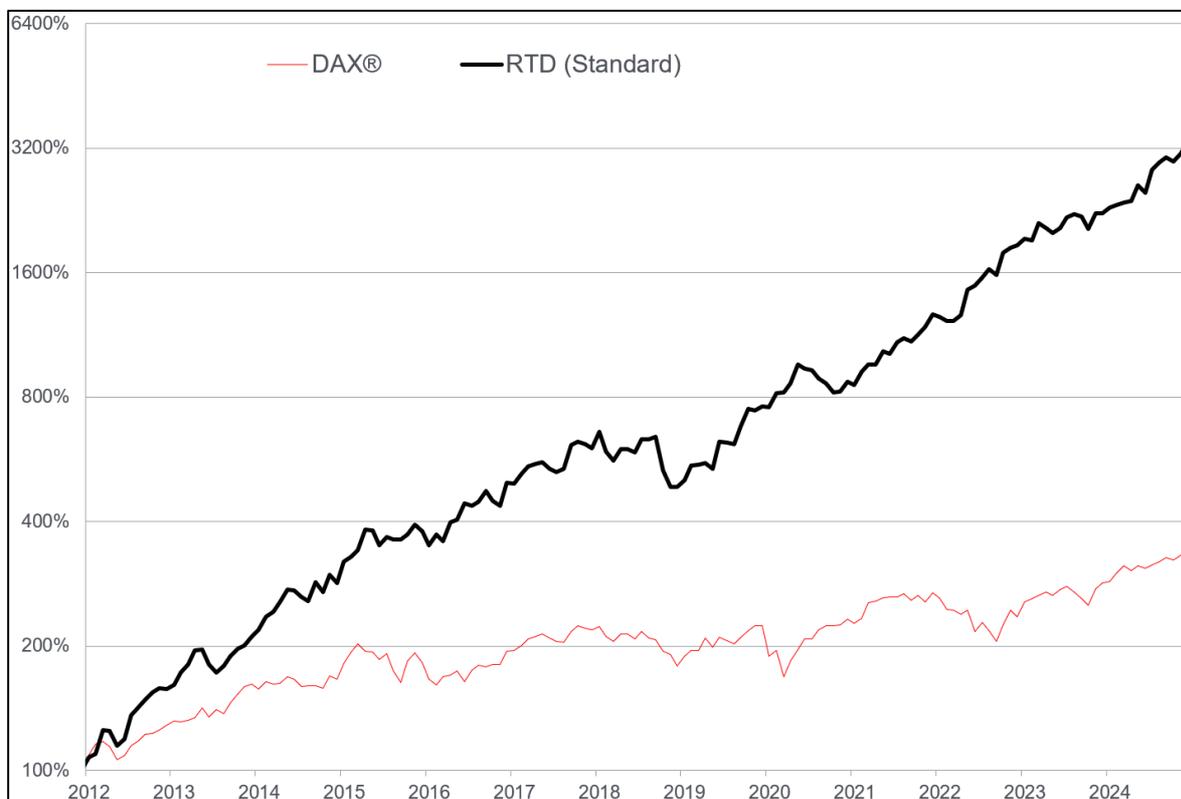
Bitte beachten Sie bei kleineren Konten unbedingt: Je kleiner die Kontogröße, desto spekulativer wird die Umsetzung. Das liegt an den von jedem Broker vorgegebenen Mindestpositionsgrößen. Die Positionsgröße bei DAX-CFDs kann nicht unter 0,10 CFDs reduziert werden. Steht der DAX z.B. bei 16.000 Punkten, müssen immer mindestens $0,1 \times 16.000 \text{ EUR} = 1.600 \text{ EUR}$ gehandelt werden. Detaillierte Informationen dazu erhalten Sie in der „Anleitung für die Installation und Einrichtung der Robotrading DAX Handelsroboter“ im Kapitel „Beschreibung der verfügbaren Handelsparameter“, beim Parameter „Ordergröße_in_Prozent_vom_Konto“.

Informationen zum Rundum-Sorglos-Paket finden Sie hier: www.robotrading.de/rsp

Die Zielperformance der Robotrading DAX-Roboter basiert auf unseren Erfahrungen im Live-Handel, sowie auf langjährigen Tests. In den nachfolgenden Tabellen und Grafiken sehen Sie die Backtest-Performance mit den Einstellungen der Standardumsetzung und der spekulativen Umsetzung seit dem Jahr 2012.



Performance von Robotrading DAX (Standardumsetzung)



Jahr	JAN	FEB	MAR	APR	MAI	JUN	JUL	AUG	SEP	OKT	NOV	DEZ	YTD
2012	8.0%	1.6%	14.1%	-0.1%	-8.1%	3.9%	14.0%	4.6%	4.1%	4.3%	2.5%	-0.5%	57.7%
2013	2.2%	7.0%	5.0%	8.1%	0.2%	-7.8%	-4.5%	3.5%	5.6%	4.2%	2.1%	4.9%	33.7%
2014	4.0%	7.5%	2.7%	5.7%	7.1%	-0.6%	-3.6%	-2.2%	11.2%	-5.3%	9.8%	-4.4%	34.8%
2015	13.0%	2.6%	3.6%	12.3%	-0.4%	-8.0%	4.8%	-1.5%	0.1%	2.9%	5.4%	-3.6%	33.4%
2016	-7.4%	6.3%	-3.6%	10.6%	1.8%	9.3%	-1.4%	2.2%	6.5%	-5.4%	-3.0%	13.7%	30.9%
2017	-0.1%	5.4%	4.2%	1.5%	0.8%	-3.7%	-1.6%	1.7%	14.3%	2.0%	-1.7%	-2.1%	21.4%
2018	9.6%	-10.3%	-5.1%	6.5%	0.0%	-1.9%	7.9%	0.0%	1.3%	-17.2%	-8.9%	0.4%	-19.2%
2019	3.6%	8.5%	0.3%	1.2%	-3.3%	16.5%	-0.8%	-0.5%	10.6%	9.7%	-0.6%	2.4%	56.5%
2020	-0.8%	8.3%	0.6%	5.2%	10.8%	-2.3%	-0.7%	-4.7%	-2.7%	-5.0%	0.8%	5.6%	14.6%
2021	-1.7%	7.4%	4.2%	0.1%	7.5%	-1.1%	6.4%	2.3%	-1.6%	3.5%	4.9%	7.1%	45.7%
2022	-1.6%	-2.4%	0.0%	3.6%	15.1%	2.1%	5.0%	4.7%	-3.4%	13.0%	3.1%	1.4%	46.7%
2023	3.6%	-0.9%	9.9%	-2.3%	-2.9%	2.8%	6.0%	2.1%	-1.6%	-6.7%	9.2%	0.0%	19.4%
2024	3.0%	1.6%	1.6%	0.8%	9.2%	-4.0%	13.4%	4.4%	2.4%	-2.1%	4.7%	6.5%	48.7%

Wertentwicklung

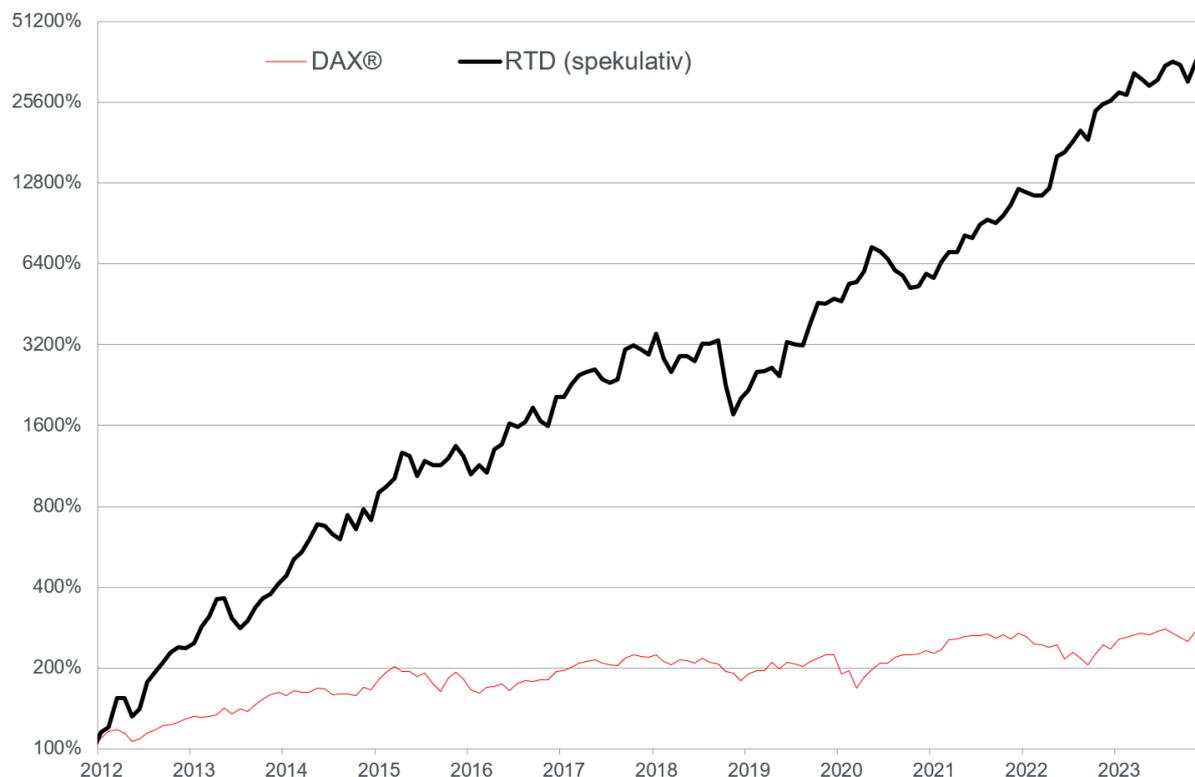
1 Monat	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Ø Rendite
6.51%	32.35%	48.71%	160.60%	335.07%	1066.36%	30.90%

Kennzahlen

Ø Volatilität	Sharpe Ratio	Treynor Ratio	Tracking Error	Max. DDn	max. Gewinnserie	max. Verlustserie
19.40%	1.49	0.50	0.18	-26.57%	10	5

Abb. 1: Die durchschnittliche Performance in der Standardumsetzung des seit 2012 laufenden Backtests betrug +30,90% pro Jahr. Der maximale Drawdown auf Monatsendbasis betrug -26,57%.

Performance von Robotrading DAX (spekulative Umsetzung)



Jahr	JAN	FEB	MAR	APR	MAI	JUN	JUL	AUG	SEP	OKT	NOV	DEZ	YTD
2012	15.5%	4.2%	28.7%	0.0%	-15.1%	7.2%	25.6%	9.2%	8.3%	9.3%	4.3%	-0.9%	137%
2013	4.4%	15.5%	9.2%	16.2%	0.3%	-15.4%	-8.5%	7.0%	12.2%	8.1%	3.8%	9.1%	74.3%
2014	6.9%	15.5%	5.4%	11.7%	14.4%	-1.2%	-7.1%	-4.3%	23.3%	-11.2%	18.5%	-8.7%	72.9%
2015	26.7%	5.1%	6.8%	24.7%	-2.8%	-15.7%	13.8%	-3.6%	0.2%	5.9%	11.1%	-7.7%	73.4%
2016	-14.6%	7.8%	-6.5%	22.5%	4.5%	19.4%	-2.8%	4.3%	13.2%	-10.7%	-4.2%	28.5%	65.9%
2017	-0.2%	11.0%	8.3%	3.0%	1.7%	-7.6%	-3.3%	2.9%	29.3%	3.9%	-3.4%	-4.4%	43.6%
2018	19.6%	-19.6%	-10.6%	14.6%	-0.2%	-4.2%	16.9%	-0.3%	2.5%	-31.6%	-22.6%	14.6%	-31.8%
2019	7.5%	17.5%	0.7%	2.4%	-6.4%	34.0%	-2.2%	-0.6%	21.1%	18.8%	-1.3%	4.6%	136%
2020	-2.2%	16.3%	1.2%	10.3%	22.9%	-3.7%	-6.3%	-9.2%	-4.2%	-10.5%	1.5%	11.4%	24.0%
2021	-3.6%	15.1%	8.3%	0.2%	15.4%	-2.4%	12.6%	4.4%	-3.2%	6.7%	9.7%	14.6%	107%
2022	-2.7%	-3.0%	0.0%	7.0%	30.6%	3.8%	10.2%	9.3%	-7.3%	27.9%	6.2%	2.8%	113%
2023	7.4%	-1.8%	19.9%	-4.6%	-5.8%	5.6%	12.3%	4.1%	-3.3%	-13.2%	19.5%	0.0%	40.4%
2024	6.0%	3.3%	3.1%	3.8%	20.0%	-7.9%	24.9%	7.8%	4.8%	-4.2%	6.9%	13.1%	112%

Wertentwicklung

1 Monat	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Ø Rendite
13.07%	63.35%	111.53%	534.02%	1526.28%	10708.57%	66.75%

Kennzahlen

Ø Volatilität	Sharpe Ratio	Treynor Ratio	Tracking Error	Max. DDn	max. Gewinnserie	max. Verlustserie
39.23%	1.65	0.56	0.35	-50.19%	10	5

Abb. 2: Die durchschnittliche Performance in der spekulativen Umsetzung des seit 2012 laufenden Backtests betrug +66,75 % pro Jahr. Der maximale Drawdown auf Monatsendbasis betrug -50,19 %.

Flexible Rendite- und Risikoeinstellungen sind möglich

Die oben gezeigten Ergebnisse wurden mit unseren Standardeinstellungen und der spekulativen Einstellung erzielt (siehe Kapitel „Einstellungen und Handelsinstrumente“). Durch eine Änderung der verwendeten Positionsgrößen und der Höhe des Stopp-Loss können Sie den Spekulationsgrad auf Ihre Bedürfnisse anpassen. Wenn Ihnen also unsere vorgeschlagenen Einstellungen zu spekulativ oder zu konservativ sind, dann können Sie darüber das Risiko und den Ertrag erhöhen oder reduzieren.

Durch die gleichzeitige Umsetzung verschiedener Robotrading-Strategien lässt sich die Rendite erhöhen und das Risiko reduzieren.

Wenn Ihnen Robotrading DAX gefällt, dann sollten Sie es durch unsere anderen Robotrading-Strategien ergänzen. Ab 7.000 € Kapital lässt sich Robotrading DAX zum Beispiel zusammen mit dem Robotrading Portfolio auf einem oder zwei parallelaufenden Konten umsetzen. Dort wird dann in einem Konto der DAX und in dem anderen Konto das Devisen-Portfolio gehandelt.

Das ist besonders lukrativ, weil die Strategien sich gegenseitig gut ergänzen. Zusätzlich wird durch den Handel nicht miteinander korrelierender Basiswerte sowie nicht korrelierender Strategien eine höhere Diversifikation erreicht. Es ist also absolut sinnvoll, mehrere Strategien als „Team“ zu begreifen und sie parallel laufen zu lassen.

Hier finden Sie weitere Informationen: www.robotrading.de/portfolio/registrierung

Einstellungen und Handelsinstrumente

Die Umsetzung der Robotrading DAX-Roboter erfolgt über CFDs (Contracts for Difference) auf den DAX-Index. Diese CFDs müssen von Ihrem Broker in der Metatrader5-Plattform angeboten werden.

So funktionieren CFDs

CFD ist in der Finanzwelt die Abkürzung für „Contract for Difference“, was auf Deutsch „Differenzkontrakt“ bzw. „Differenzgeschäft“ bedeutet. Mit Differenz ist der Unterschied zwischen Kaufkurs und Verkaufskurs der zugrundeliegenden Position gemeint. Anstatt z. B. eine Aktie zu kaufen und später wieder zu verkaufen, wird Ihrem Konto bei einem CFD nur die Differenz zwischen ihrem Einstiegskurs und dem aktuellen Verkaufskurs gutgeschrieben oder abgezogen. Dadurch benötigen Sie für den gleichen Effekt wesentlich weniger Kapital, Ihr Geld kann sich also effektiver vermehren.

Für das Differenzgeschäft erwerben Sie keine Aktien, Indizes oder Rohstoffe und profitieren dennoch 1:1 von den Schwankungen des zugrundeliegenden Basiswertes (bei uns also dem DAX).

Für die CFD-Position hinterlegen Sie bei Ihrem Broker eine Sicherheitseinlage, die so genannte Margin. Die Margin wird ständig neu berechnet, je nach Kursentwicklung des zugrundeliegenden Basiswertes. Da die CFD-Position dem Kurs des Basiswertes 1:1 folgt, die Margin jedoch nur einen Bruchteil des Gesamtwertes des Basiswertes beträgt (in der Regel 2 % bis 20 %), ergibt sich daraus ein Hebeleffekt,

den Sie sich zunutze machen können. Beim DAX müssen Sie in der Regel 5% Sicherheitsleistung hinterlegen, um einen DAX-Index handeln zu können. Das entspricht einem Hebel von 1:20.

CFDs haben keinen eigenen Nominalwert wie z. B. eine Aktie, mit der ein Investor einen Firmenanteil erwirbt. Es handelt sich bei CFDs stattdessen um sogenannte Derivate, also derivative (abgeleitete) Finanzinstrumente. Ihr Kurs spiegelt den des Basiswertes wider.

So konfigurieren Sie die Robotrading DAX-Handelsroboter

Die Konfiguration der RTD-Roboter ist denkbar einfach. Dabei geht es bei beiden Robotern im Wesentlichen um zwei Fragen: Mit welchen Positionsgrößen soll der Roboter handeln? Und: Wie viel Verlust darf der Handelsroboter maximal hinnehmen, bevor er Positionen schließt (Sicherheitsstopp)? Prinzipiell gilt: Je größer die Positionsgröße, umso größer wird der mögliche Ertrag, aber auch das Risiko.

Unsere Beispiel-Einstellungen entnehmen Sie bitte den nachfolgenden Tabellen. Wenn Sie die Standardumsetzung wählen, dann müssen Sie die Einstellungen des Handelsroboters nicht zu verändern. Sie können im „Auslieferungszustand“ bleiben. Die Standardeinstellungen sind aufgrund der prozentualen Parameterverwendung auf jede Kontogröße anwendbar, wir empfehlen allerdings mindestens 5.000 EUR. Sie müssen lediglich für jede Strategievariante einen Chart aufsetzen und Ihre Lizenznummer eingeben. Für die spekulative Umsetzung müssen Sie nur die Positionsgröße und den Stop Loss anpassen. Insgesamt wären dann 3 Charts mit unseren DAX-Robotern aktiv.

Gerade für Einsteiger ist es sinnvoll, sich an unseren Standard-Einstellungen zu orientieren. Erfahrene Anwender können aber auch variieren und z. B. die Positionsgrößen für eine spekulativere Einstellung vergrößern oder für eine konservativere Einstellung verkleinern.

Robotrading DAX in der Standardumsetzung (ab 5.000 EUR)

Markt	RPP EA	CFD-Bezeichnung z.B.	Chart Zeiteinheit	Stop Loss in % vom Konto	Positionsgröße pro Trade in % vom Konto	Aktivierte Trading Level	Handelszeiten
DAX	RTD-Basis (Variante 1)	.GER40C	M15-M30	2%	100%	Level_1 und 2	09:00 -17:30
DAX	RTD-Basis (Variante 2)	.GER40C	M15-M30	2%	100%	Level_1 und 2	09:00 -17:30
DAX	RTD-Long	.GER40C	M15-M30	25%	40%	Level_1 und 2	09:00 -17:30

Hinweis: Der RTD-Handelsroboter verfügt über zwei einstellbare Strategievarianten (siehe Installationsanleitung). In der Standardumsetzung verwenden wir beide Varianten, der RTD-Basis-Roboter wird also auf zwei Charts aufgesetzt. Der RTD-Long-Roboter wird auf einem Chart aufgesetzt.

Robotrading DAX in der spekulativen Umsetzung (ab 5.000 EUR)

Markt	RPP EA	CFD-Bezeichnung z.B.	Chart Zeiteinheit	Stop Loss in % vom Konto	Positionsgröße pro Trade in % vom Konto	Aktiviertes Trading Level	Handelszeiten
DAX	RTD-Basis (Variante 1)	.GER40C	M15-M30	4%	200%	Level_1 und 2	09:00 -17:30
DAX	RTD-Basis (Variante 2)	.GER40C	M15-M30	4%	200%	Level_1 und 2	09:00 -17:30
DAX	RTD-Long	.GER40C	M15-M30	50%	80%	Level_1 und 2	09:00 -17:30

Hinweis: Auch in der spekulativen Umsetzung verwenden wir beide Strategievarianten des RTD-Basis-Roboters. Sie benötigen also zwei Charts für den RTD-Basis-Roboter und einen Chart für den RTD-Long-Roboter.

Die detaillierte Beschreibung aller Einstellungsmöglichkeiten finden Sie in der Anleitung zur Installation und Einrichtung, unter: www.robotrading.de/anleitungen/installation-und-einrichtung-rtd

So können Sie Einstellungen anpassen

In diesem Video zeigen wir Ihnen wie Sie die Einstellungen des DAX-Roboters anpassen können: www.robotrading.de/dax/schnelleinstieg/#schritt-6

Robotrading DAX (RTD) auf Konten mit weniger als 5.000 EUR Kapital

RTD lässt sich ab 2.000 Euro Kapital umsetzen. Auch für die Umsetzung im Rahmen des Rundum-Sorglos-Pakets werden dank einer Ausnahmeregelung des Brokers für Robotrading DAX-Kunden nur 2.000 Euro benötigt. Aber: Die Kontoschwankungen sind auf kleineren Konten wesentlich größer. Das liegt vor allem daran, dass jeder Broker eine kleinstmögliche Positionsgröße hat. Der Roboter kann also nicht beliebig stückeln, sondern handelt immer mindestens mit dieser kleinstmöglichen Größe. Dadurch erhöht sich der Spekulationsgrad und das Risiko deutlich, [siehe Anleitung zur Installation](#).

Insbesondere der Long-EA wird bei kleineren Konten spekulativer. Das liegt daran, dass er mit kleineren Positionsgrößen tradet. In der Standardumsetzung eröffnet er pro Trade Positionsgrößen in Höhe von 40% der Kontogröße. Bei einer Kontogröße von 2.000 EUR „möchte“ er also Positionsgrößen von 800 EUR handeln (40% von 2.000 EUR). Beim Broker ist die kleinstmögliche Positionsgröße allerdings 0,1 CFDs, was bei einem DAX-Stand von 16.000 Punkten 1.600 EUR entspricht. Der Roboter wird also gezwungen höhere Positionsgrößen zu nehmen und dadurch steigt nicht nur das Gewinnpotenzial, sondern gleichermaßen auch das Risiko.

Für wen ist welche Umsetzung geeignet?

Für die meisten Nutzer ist die Standardumsetzung die richtige Wahl. Sie zeigt in unseren Tests ein sehr gutes Verhältnis zwischen Rendite und dem dafür erforderlichen Risiko. Die Schwankungen bei der spekulativen Umsetzung werden von unerfahrenen Anwendern erfahrungsgemäß oft unterschätzt. Wer

damit kein Problem hat, kann auch auf die spekulative Umsetzung zurückgreifen. Beide Varianten sind im Rundum-Sorglos-Paket umsetzbar. Alle Infos dazu finden Sie hier: www.robotrading.de/rsp.

Unsere Einstellungen basieren auf Erfahrungswerten und Daten aus der Vergangenheit. Sie sind keine Garantie für Erfolge in der Zukunft. Wir beobachten die Märkte permanent, sodass wir bei veränderter Marktsituation auch Anpassungen an der Strategie durchführen können. Unser Anspruch ist es, Ihnen eine Möglichkeit für überdurchschnittliche Performance mit klar kalkulierbaren Risiken zu bieten.

Die Robotrading DAX-Strategie einfach erklärt

Die Handelslogik unseres RTD-Basis-Roboters

Der Robotrading DAX-EA nutzt einen Algorithmus, der in zwei unterschiedlichen Varianten angewendet wird. Jede dieser zwei Strategievarianten reagiert unterschiedlich sensibel auf Marktschwankungen (Volatilität). Die Berechnung dieser Marktschwankung erfolgt auf Basis der *Standardabweichung* und der *Average True Range*. Die Standardabweichung misst die Schwankung der Kurse um deren Durchschnittswert. Die Average True Range ist ein Risikomaß aus der technischen Chartanalyse. Sie erfasst die Tagesschwankungen unter Einbeziehung des Schlusskurses des jeweiligen Vortages.

Beide Risikomaße dienen als Filter. Sie sollen Phasen identifizieren, in denen das Chance-Risiko-Verhältnis für den Handel positiv ist. Auf diese Weise soll das Risiko des Handels reduziert werden. Insgesamt unterscheidet die Handelslogik drei Volatilitätsstufen:

1) Sehr niedrige Volatilität – kein Trading

Grundsätzlich handelt der RTD-Roboter nur dann, wenn eine gewisse Mindestschwankung am Markt vorliegt. Ist die Volatilität zu niedrig, erfolgt kein Trading.

2) Niedrige bis mittlere Volatilität – Breakout-Trading

Liegt die aktuelle Volatilität im Vergleich zu Ihrer Historie im niedrigen bis mittleren Bereich, dann erwartet der Algorithmus das Einsetzen neuer Trends. Er handelt dann sogenannte Breakout-Trades, wenn die Höchst- bzw. Tiefststände der letzten Stunden bzw. Tage über- oder unterschritten werden. Die Eröffnung der Positionen erfolgt über Opening-Stopp-Orders.

Eröffnung einer Long-Position, wenn das Niveau der Höchstkurse der letzten Stunden oder Tage nach oben durchbrochen wird:

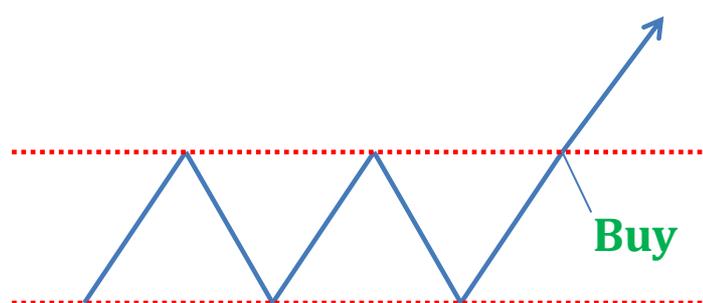


Abb. 3: Beispiel für einen Breakout-Trade zum Kauf



Eröffnung einer Short-Position, wenn das Niveau der Tiefstkurse der letzten Stunden oder Tage nach unten durchbrochen wird:

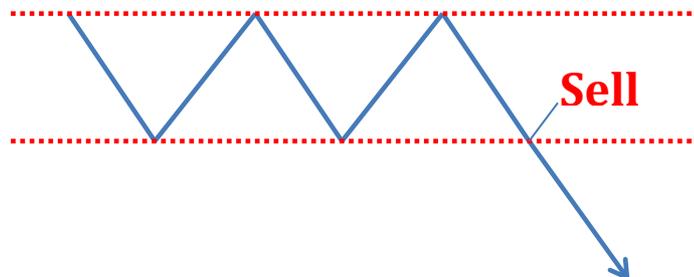


Abb. 4: Beispiel für einen Breakout-Trade zum Verkauf

Offene Positionen werden immer durch Stopp-Orders abgesichert, die als sogenannte Trailing-Stops der Marktbewegung folgen. Der Abstand hängt von der kurzfristigen Schwankungsbreite des Kursverlaufs ab. Je niedriger die kurzfristige Volatilität, desto näher liegt der Trailing-Stopp. Der Begriff „Trailing“ (engl. „folgen“) beschreibt das Verhalten dieser Art des Stops: Beim Erreichen neuer Höchststände (Long-Trades) bzw. neuer Tiefststände (Short-Trades) folgt er immer der Marktbewegung. Das Risiko wird dabei im Laufe des Trades immer kleiner, bis der Stopp in die Gewinnzone nachgezogen wird. Der Roboter schließt dann die Position mit einem Gewinnziel oder wenn der Kurs den nachgezogenen Stopp berührt.

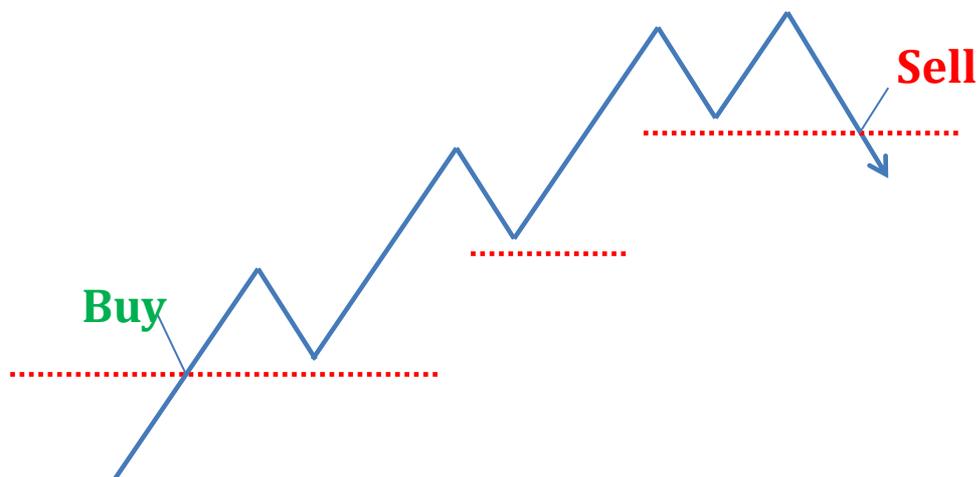


Abb. 5: Beispiel für die Arbeitsweise eines Trailing-Stops

3) Überdurchschnittlich hohe Volatilität – kein Trading

Ist die kurzfristige Volatilität relativ hoch, dann können wir nicht mehr von Kursausbrüchen aus ruhigen Phasen profitieren. Das Risiko von Fehltrades würde steigen. Deshalb erfolgt dann auch kein Trading mehr.

Diversifikation sorgt für stabile Ergebnisse

Um eine möglichst stabile Wertentwicklung zu erreichen, wird die Handelslogik des RTD-Basis-Roboters in zwei Varianten auf verschiedenen Zeitebenen angewendet. Diese zweidimensionale Diversifikation führt zu einer geringeren Schwankung der Wertentwicklung und zu zeitlich kürzeren und geringeren Drawdowns (Verlustphasen).

Durch den Einsatz dieser verschiedenen Zeitebenen kann es vorkommen, dass die kürzere Zeitebene eine offene Position mit Gewinn schließt, während die längere Zeitebene zur selben Zeit eine Position eröffnet. Auch kann es vorkommen, dass der Roboter in der kurzfristigen Zeitebene auf der Longseite positioniert ist – also gekauft hat – während er auf der längerfristigen Zeitebene auf der Shortseite positioniert ist – also verkauft hat.

Für eine weitere Diversifikation sorgt der parallele Einsatz des RTD-Long-Roboters. Auf diesen gehen wir später weiter ein.

Zusätzlich zur o.g. Diversifikation ist es bei größeren Konten (ab 7.000 € Kapital) auch möglich, weitere Robotrading-Strategien hinzuzunehmen. So können Sie beispielsweise durch den gleichzeitigen Einsatz von Robotrading DAX und Robotrading Portfolio (Handel mit Devisen) Ihren Ertrag bei verringertem Risiko deutlich steigern. Hier finden Sie weitere Informationen zum Robotrading Portfolio: www.robotrading.de/portfolio/registrierung

In diesen Marktphasen funktioniert der RTD-Basis-Roboter besonders gut

Da der RTD-Basis-Roboter mit der oben beschriebenen Ausbruchsstrategie arbeitet, funktioniert er insbesondere zu Beginn stärkerer Marktbewegungen sehr gut. Besonders starke Marktbewegungen gibt es meist in Krisenzeiten, somit stellt unsere Robotrading DAX-Strategie auch eine sehr gute Diversifikation bzw. Ergänzung zu einem Aktieninvestment bzw. langfristigen Aktienportfolio dar. Das Crashrisiko Ihrer Aktien kann durch unseren RTD-Basis-Roboter aufgefangen werden.

Beispiel: Der RTD-Basis-Roboter im Einsatz

Anders als bei den meisten anderen Investmentstrategien können Sie mit unserem RTD-Basis-Roboter auch bei fallenden Kursen Geld verdienen. Dies bietet Ihnen auch in stürmischen Zeiten Ertragschancen. Die folgende Abbildung zeigt Ihnen die Handelsweise des RTD-Basis-Roboters in einem bestehenden Abwärtstrend, der 4 Tage anhält. Hierbei nahm der Roboter durch gut platzierte Short-Trades regelmäßig Gewinne mit und sprang auf den Abwärtstrend wieder auf, als dieser sich fortsetzte:



Abb. 6: Arbeitsweise des RTD-Basis-Roboters bei fallendem DAX

Zu den Signalen im Einzelnen:

Der erste Trade war ein Verkauf am 12. Mai (Short_DAX). Diese Position wurde aufgrund der starken Abwärtsbewegung bis in den nächsten Tag offengelassen und mit 229 Punkten Gewinn am Morgen des nächsten Tages geschlossen (Exit_Short). Zur gleichen Zeit erfolgte in der längerfristigen Zeitebene ein Shortsignal (Short_DAX), welches am 13. Mai umgesetzt wurde. Der Roboter verkaufte den DAX und eröffnete eine Shortposition. Am Nachmittag des 13. Mai eröffnete der Roboter in der kurzfristigen Zeitebene eine zweite Shortposition, als sich die Abwärtsbewegung weiter fortsetzt. In der Nähe des Tagestiefs erreichte der DAX dann das Kursziel der kurzfristigen Shortposition (Exit_Short). Der Roboter schloss die Position und sicherte damit den Gewinn von 133 Punkten noch am selben Tag. Die längerfristige Shortposition schloss er am 15. Mai mit 208 Punkten Gewinn (Exit_Short). Während der DAX um 440 Punkte (-4,06 %) fiel, realisierte unser Handelsroboter innerhalb von 3 Tagen einen Gewinn von 570 Punkten bzw. +5,7%.

Die Handelslogik unseres RTD-Long-Roboters

Um die Diversifikation innerhalb von Robotrading DAX weiter zu erhöhen und ein noch stabileres Ergebnis zu erzielen, haben wir mit dem RTD-Long-Roboter ein weiteres Ass im Ärmel. Dieser handelt ausschließlich auf der Longseite, profitiert also von steigenden Kursen. Die Handelslogik des RTD-Long-Roboters zielt darauf ab, insbesondere in Phasen mit niedriger oder durchschnittlicher Volatilität Erträge zu erzielen. Das funktioniert am besten mit Long-Trades, da in der Regel die Gewinnphasen (Aufwärtstrends) an der Börse deutlich länger andauern als die Verlustphasen (Abwärtstrends).

Wann der Roboter Trades eröffnet, ist abhängig von der aktuellen Marktschwankung. Die Berechnung der Marktschwankung erfolgt auf Basis der annualisierten Volatilität der jeweils letzten 30 Tage. Die Handelslogik unterscheidet dabei zwei Volatilitätsstufen:

1. Niedrige bis mittlere Volatilität – Long Trading

Liegt die aktuelle Volatilität im Vergleich zu Ihrer Historie im niedrigen bis mittleren Bereich, dann antizipiert der Algorithmus eine positive Stimmung an den Aktienmärkten und setzt auf ansteigende Kurse des DAX-Index. Dabei versucht er möglichst viele kleinere Gewinne zu realisieren.

Um das zu erreichen, verhält sich der Roboter ähnlich wie ein sogenanntes „Grid-Trading-System“. Gelingt es nicht, zeitnah mit dem ersten Kauf einen Gewinn zu erzielen, dann platziert der Roboter weitere Kauforders unter dem aktuellen Kurs, um bei Rücksetzern mit weiteren Einstiegen nachzukaufen. So eröffnet er bis zu 4 Positionen, um den durchschnittlichen Einkaufspreis zu senken.

Abb. 7: Beispiel für den Einstieg des RTD-Long

Erhöhung einer Long-Position, bei fallenden Kursen mit späterer Gewinnmitnahme durch den Verkauf der gesamten Long-Position.



2. Überdurchschnittlich hohe Volatilität – Handelsstopp und pausieren des Handels

In Phasen überdurchschnittlich hoher Volatilität schließt der Algorithmus seine noch offenen Long-Positionen und ändert sein Trading-Verhalten. Der Roboter hält sich dann mit neuen Einstiegen zurück und legt eine Trading-Pause ein, bis die Volatilität sich wieder deutlich reduziert hat.



Beispiel: Der RTD-Long-Roboter im Einsatz



Abb. 8: Beispiel für einen Einstieg des RTD-Long-Roboters mit einer Optimierung des durchschnittlichen Einstiegspreises.

Der obige Chart zeigt eine typische Tradeserie des RTD-Long-Roboters: Drei Käufe bei 7.900 bei 7.700 und bei 7.510 Punkten führten zu einem durchschnittlichen Einstiegspreis von 7.703 Punkten. Die Position wurde ca. 3 Wochen später bei 7.930 Punkten geschlossen. Der Gewinn pro Trade betrug $7.930 - 7.703 = 227$ Punkte. Insgesamt betrug der Ertrag der 3 Eröffnungen 681 Punkte oder +8,58%. Ein schönes Ergebnis für eine einzige Tradeserie.

Sie haben den wichtigsten Schritt in Richtung finanzieller Unabhängigkeit gemacht. Viel Erfolg!

Mit Robotrading DAX haben Sie den perfekten Einstieg in die Welt des automatisierten Handels gewählt. Stressfreier lässt sich kein Geld verdienen. In Zukunft können Sie sich entspannt zurücklehnen, während unsere Handelsroboter für Sie arbeiten.

Wir hoffen, dass Sie die Robotrading DAX-Roboter mithilfe dieser Anleitung schnell und unkompliziert umsetzen können. Bei Fragen stehen wir Ihnen natürlich jederzeit zur Verfügung. Falls Sie sich überhaupt nicht mit der Umsetzung beschäftigen möchten, schauen Sie sich bitte das „Rundum-Sorglos-Paket“ an. Auf Wunsch setzt ein Broker das komplette Robotrading DAX für Sie um. Weitere Informationen darüber finden Sie hier: www.robotrading.de/rsp

Bitte beachten Sie: Sie müssen stets darauf vorbereitet sein, dass der Markt auch einmal gegen Ihr Depot laufen kann. Dann muss Ihr Konto groß genug sein, um einen Drawdown zu verkraften und weiteres Agieren am Markt zu ermöglichen. Bitte übertreiben Sie es daher mit der Positionsgröße nicht. Generell gilt (wie bei allen Investments) auch beim Robotrading DAX: Traden Sie nie mit Geld, das Sie sich geliehen haben oder auf das Sie für Ihren Lebensunterhalt angewiesen sind. Weitere Informationen und Links zum Thema Risiko finden Sie im Disclaimer auf der letzten Seite dieser Anleitung.

Wir hoffen, dass Ihnen diese Anleitung den Einstieg bei Robotrading erleichtert. Nun bleibt uns nur noch, Ihnen viel Freude und Erfolg beim Trading zu wünschen!

Ihr



Marius Müller
Chefentwickler

&



Silvio Graß
Chefredakteur und Portfoliomanager

Robotrading Kundenservice

Das Robotrading-Archiv:

Sie können das komplette Archiv mit allen Ausgaben ganz einfach und problemlos im Internet unter www.robotrading.de/dax einsehen.

Passwort vergessen?

Falls Sie Ihr Passwort zum geschützten Bereich einmal vergessen sollten, können Sie sich hier ein neues erstellen: www.robotrading.de/passwort-vergessen

Unser VIP-Nachrichtensystem:

Sie können uns ganz einfach und schnell eine Nachricht über www.robotrading.de/kontakt schicken. Wir antworten immer schnellstmöglich.

Die Robotrading-Telefon-Hotline:

Wenn Sie Fragen zu unserer Strategie haben, können Sie uns auch persönlich am Telefon sprechen. Die jeweilige Sprechzeit entnehmen Sie bitte der aktuellen Wochenausgabe.

Der Schnelleinstieg für den perfekten Start:

Um Ihnen den Einstieg ins Robotrading DAX so einfach wie möglich zu machen, haben wir auf einer Internetseite alles Wesentliche zusammengefasst: www.robotrading.de/dax/schnelleinstieg

Impressum

Investor Verlag, ein Unternehmensbereich der
FID Verlag GmbH
Koblenzer Straße 99
53177 Bonn – Bad Godesberg

Telefon: 0228 / 955 0430
Fax: 0228 / 3696 499
Internet: <http://www.investor-verlag.de/>
E-Mail: info@investor-verlag.de

USt.-ID: DE 811270471
Amtsgericht Bonn, HRB 7435
Geschäftsführung: Richard Rentrop

Chefredakteur: Silvio Graß (V.i.S.d.P), Berlin

Weitere Angaben zu unserem Unternehmen entnehmen Sie bitte dem [Impressum auf unserer Website](#)

Angaben zum Thema Datenschutz entnehmen Sie bitte unserer [Datenschutzerklärung](#)

Disclaimer

Wir machen Sie vorsorglich darauf aufmerksam, dass die hier enthaltenen Finanzanalysen und Empfehlungen zu einzelnen Finanzinstrumenten eine individuelle Anlageberatung durch Ihren Anlageberater oder Vermögensberater nicht ersetzen können. Unsere Analysen und Empfehlungen richten sich an alle Abonnenten und Leser unseres Börsenbriefes, die in ihrem Anlageverhalten und ihren Anlagezielen sehr unterschiedlich sind. Daher berücksichtigen die Analysen und Empfehlungen dieser Publikation in keiner Weise Ihre persönliche Anlagesituation.

Dies gilt insbesondere auch für die vom Redakteur beschriebenen Einstellungen und Handelsstrategien in den Expert Advisor. Weder durch den Bezug dieser Veröffentlichung noch durch die darin ausgesprochenen Einstellungen und Handelsstrategien oder wiedergegebenen Meinungen kommt ein Anlageberatungs- oder Anlagevermittlungsvertrag zustande. Jegliche Einstellungen übernimmt der Kunde in eigener Verantwortung; er muss Anbieter (Broker), Kontogröße, Positionsgrößen, etc. eigenständig vornehmen.

Zur Sicherung der journalistischen Unabhängigkeit der FID Verlag GmbH handeln alle Mitarbeiter und Redakteure nach den publizistischen Grundsätzen des Deutschen Presserates (Pressekodex) sowie nach den Journalistischen Verhaltensgrundsätzen und Empfehlungen des Deutschen Presserats zur Wirtschafts- und Finanzmarktberichterstattung (Verhaltensgrundsätze). Der Pressekodex enthält Richtlinien für die publizistische Arbeit nach den Empfehlungen des Deutschen Presserats. Die Verhaltensgrundsätze berücksichtigen die gesetzlichen Regelungen der Marktmissbrauchsverordnung (MAR) zum Verbot von Insidergeschäften und von Marktmanipulation und konkretisieren den Pressekodex im Hinblick auf die Erstellung, Weitergabe und Veröffentlichung von Anlageempfehlungen oder Anlagestrategieempfehlungen journalistischen Publikationen. Sie treten an die Stelle der entsprechenden Vorschriften der Marktmissbrauchsverordnung bzw. des Wertpapierhandelsgesetzes.

Sofern nicht anders angegeben, stammen Charts und Darstellungen unserer Portfolioentwicklung von Myfxbook und basieren auf Konto-/Kursdaten von JFD Brokers. Unsere Backtests wurden mit der Software Multicharts (© MULTICHARTS, LLC) erstellt und basieren auf Kursen von TradeStation (© TradeStation Group, Inc.). Die Visualisierung der Ergebnisse erfolgt mit Microsoft-Excel.

Der Verfasser und/oder eine an der Erstellung der Publikation mitwirkende natürliche oder juristische Person, und/oder deren Angehörige oder verbundene Unternehmen halten möglicherweise Long- oder Short-Positionen betreffend die im Report genannten Finanzinstrumente. „Long-Position“ bedeutet eine Investition, mit der von steigenden Kursen des Finanzinstruments profitiert wird, wohingegen bei „Short-Positionen“ von sinkenden Kursen profitiert wird.

Um unsere Handelsroboter nutzen zu können, haben Sie bei Ihrer Bestellung (Internetbestellungen) oder Ihrem ersten Login (Bestellungen auf anderem Wege) unseren Nutzungsbedingungen zugestimmt. [Die Nutzungsbedingungen können Sie jederzeit hier einsehen.](#)

Wie bei jeglichem Handel, gibt es auch beim Einsatz von Handelsrobotern Risiken. Details finden Sie in den hier verlinkten Risikohinweisen: [Risikohinweis Robotrading Portfolio](#), [Risikohinweis Robotrading Portfolio Plus](#), [Risikohinweis Robotrading DAX](#).