



Bestimmung der Risikorahmenbedingungen für Dein Trading.

1. Risikokapital bestimmen:

Dein Risikokapital (z.B. 20% Deines Kontos) beträgt: _____
Rechnung: $\text{Risikokapital} = \text{Kontogröße} \times 0,2$ (0,2 = 20%)

2. Risk of Ruin bestimmen:

Verlustwahrscheinlichkeit: 50% (Für normale Tradingphasen)
Verlustserie: 10 Verlusttrades nacheinander treten weniger als 1x auf (bei 1.000 Trades)
Verlustserie: 14 Verlusttrades nacheinander treten weniger als 1x auf (bei 10.000 Trades)

Bestimmung Deines maximalen Risikos pro Trade für 1.000 Trades: _____
Rechnung: $\text{Maximales Risiko pro Trade} = \text{Risikokapital} / 10$

Bestimmung Deines maximalen Risikos pro Trade für 10.000 Trades: _____
Rechnung: $\text{Maximales Risiko pro Trade} = \text{Risikokapital} / 14$

Verlustwahrscheinlichkeit: 67% (Für Draw-Down Tradingphasen)
Verlustserie: 21 Verlusttrades nacheinander treten weniger als 1x auf (bei 1.000 Trades)
Verlustserie: 23 Verlusttrades nacheinander treten weniger als 1x auf (bei 10.000 Trades)

Bestimmung Deines maximalen Risikos pro Trade für 1.000 Trades: _____
Rechnung: $\text{Maximales Risiko pro Trade} = \text{Risikokapital} / 21$

Bestimmung Deines maximalen Risikos pro Trade für 10.000 Trades: _____
Rechnung: $\text{Maximales Risiko pro Trade} = \text{Risikokapital} / 23$

3. Risikoklassen:

Normale Phasen:

Maximales Risiko (100%): _____
Neutrales Risiko (50%): _____
Minimales Risiko (25%): _____

Draw-Down Phasen:

Maximales Risiko (100%): _____
Neutrales Risiko (50%): _____
Minimales Risiko (25%): _____

4. Deine aktuellen Verlustlimits:

Tagesloss-Limit: _____

(Etwa die Höhe eines Gewinnertrades, der bis zum Ziel gelaufen ist)

Vormittag: _____

Nachmittag: _____

Wochenloss-Limit: _____

(Z.B. maximal 5% des Kontos)

Monatsloss-Limit: _____

(Z.B. maximal 9% des Kontos)

5. Deine aktuellen Risikolimits:

Maximales Risiko gleichzeitig Daytrading: _____

(Darf z.B. nicht höher als das Tagesloss-Limit sein!)

(Verringert sich natürlich, wenn bereits Verlusttrades am gleichen Tag gemacht wurden!)

Maximales Risiko gleichzeitig Swingtrading: _____

(Darf z.B. nicht höher als das Wochenloss/Monatsloss-Limit sein!)

(Verringert sich natürlich, wenn bereits Verlusttrades am gleichen Tag gemacht wurden!)

HINWEIS: Wenn Du z.B. bereits einen Swingtrade mit dem maximalen Monatsrisiko eingegangen bist und Du Dich noch im vollen Risiko des Trades befindest, können keine weiteren Trades mehr (sowohl Daytrading als auch Swingtrading) getätigt werden, bis Du Dein Risiko in dem offenen Trade reduzieren konntest!!

6. Bestimme Deine Märkte, die Du handeln kannst:

Jetzt musst Du Dir Märkte/Instrumente suchen, in denen Du gemäß Deiner Risiken handeln kannst.

Dazu kannst Du die 2x ATR (auf der Zeitebene, auch der Du handelst!) als Mindestkriterium für einen Initial Stop zur Rate ziehen und dort eine Beispielrechnung machen, ob Du in jedem Markt Trades machen kannst.

BEISPIEL:

Der FDAX hat auf dem 15min Chart eine 2xATR von 68 Punkten. Das bedeutet, dass Du ein minimales Risiko pro Kontrakt von $68 \times 25\text{€} = 1.700\text{€}$ (68Punkte x Tickwert, bei FDAX 25€) hast. Bei einem SQ-Trade mindestens $2 \times 1.700\text{€} = 3.400\text{€}$ (da 2 Kontrakte). Dein maximales Risiko hast Du aber mit 2.000€ berechnet. Dies bedeutet, dass der FDAX für Dein Risikomanagement nicht geeignet ist. Hier könntest Du die Rechnung mit dem MiniDAX wiederholen, welcher einen Tickwert von 5€ hat.