



Henning P. Schäfer
Finanz- und Börsenastrologe
Augusta-Str.13
76137 Karlsruhe

Telefon: 0721/3350765
Mobil: 0171/8462214
Webfax 24 Stunden: 01212/ 540 792 681
Email: info@cosmo-trend.com
Internet: www.cosmo-trend.com

Karlsruhe, den 16.05.2008

Cosmo-Trend Daily-Trading

Sehr geehrte Leserinnen und Leser,

in diesem Dokument möchte ich kurz den Begriff „Daily-Trading“ und die zukünftigen im Cosmo-Trend-Börsenbrief verfolgten Ziele damit erläutern.

Ein Daily-Trade ist ein Trade (Handel), der in der Regel morgens bei Markteröffnung auf Basis des vorangegangenen Schlusskurses eines beliebigen Wertes in Kombination mit einem Kaufsignal eines Handelssystems eröffnet und dann im Laufe der nächsten Tage oder Wochen wieder bei Markteröffnung auf Basis des vorangegangenen Schlusskurses geschlossen wird. Die Tradedauer kann dabei zwischen einem Tag und mehreren Wochen variieren. Es kann auch sein, dass z.B. beim Dax auf Schlusskursbasis ein Signal entstanden ist und man am nächsten Tag eine Kauforder platziert, die dann erst im Laufe des Tages ausgeführt wird. Die Grundlage des Trades basiert jedoch auf einem Handelssystem, welches auf Tageschlussbasis ein Signal erzeugt. Im Idealfall wird auch beim „Verkauf“ ein Signal auf Tageschlusskursbasis generiert und dieses dann am folgenden Morgen umgesetzt. Die Ausnahme ist der Stopp oder ein Gewinnziel. Ein gesetzter Stopp kann jederzeit innerhalb eines Tages ausgelöst werden. Cosmo-Trend setzt die Stopps für Optionsscheine in der Regel in Stuttgart, hier werden die Stopps immer von 9.00 bis 20.00 Uhr ausgeführt. Mittlerweile kann man die Stopps z.B. bei Cortal-Consors auch direkt beim Emittenten setzen, diese Stopps werden dann bis 22.00 Uhr ausgeführt. Im Einzelfall wird auf diese Situation hingewiesen. Stopps beim Dax-Future und Dax-CFDs werden von 8.00 bis 22.00 Uhr ausgeführt.

Im nachfolgenden Beispiel auf den nächsten Seiten möchte ich kurz erklären, wie das Daily-Trading für das Cosmo-Trend-Musterdepot eingesetzt wird.

Inhalt:

- Seite 1 => Grunddefinition Daily-Trading, siehe oben.
- Seite 2-4 => Beispiel eines Daily-Trades, hier DAX
- Seite 5 => Über das Chance-/Risiko-Verhältnis, die Positionsgrößenbestimmung und die Größe von R.
- Seite 5-6 => nochmalige Definitionen, Ziele und Ihre Bereitschaft

Beispiel eines Daily-Trades, hier DAX:

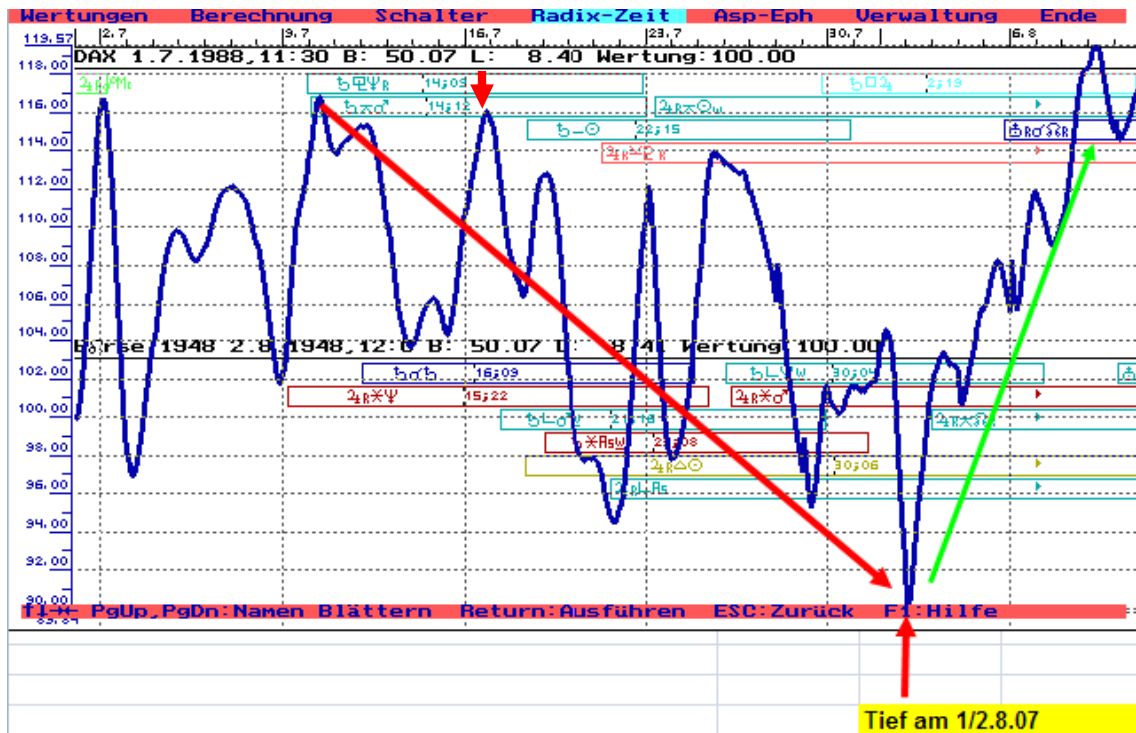
In nachfolgenden Tageschart des Dax habe ich ein Range-Short-Signal nach dem Cosmo-Trend-Handelssystem eingezeichnet. Das Signal wurde am 13.07.2007 auf Schlusskursbasis generiert (siehe roter Pfeil im Chart). Der Dax bildet an diesem Tag ein Doppeltop mit einem bearischen Doji aus. Da auch der der ADX fallend war und der Slow-Stochastik auf Verkauf stand, war eine sehr gute Put-Chance vorhanden.

Der Short-Trade hätte am 16.07.2007 bei Markteröffnung bei einem Kurs von 8101 eröffnet werden müssen.



Das untere Bollinger-Band stand am 16.07.2007 bei 7830 Punkten und das obere Bollinger-Band bei 8157 Punkten, der Widerstand lag bei ca. 8140 = Doppeltop. Die Chance nach unten betrug somit 270 Punkte. Einen guten Stopp hätte man auf Tagesbasis über dem oberen Bollinger-Band und dem Widerstand bei 8170 Punkten setzen können und somit hätte das Risiko ca. 70 Punkte betragen. Das Chance-/Risiko-Verhältnis betrug somit auf Tagesbasis ca. **3,85 zu 1**, dies ist ein besonders gutes Verhältnis. **3 zu 1** oder **4 zu 1** sind akzeptable C/R-Verhältnisse (nachfolgend meist CRV genannt). Auch der Cosmo-Chart hat am 16.07.2007 ein Hoch ausgebildet und so war das Short-Signal des Handelssystems auch astrologisch untermauert. Das Tief im Cosmo-Chart wurde am 01/02.08.2007 angezeigt.

Dax-Kombi-Cosmo-Chart vom 01.07.2007 bis 10.08.2007



Die Liste mit den mittel- bis langlaufenden Transiten des Dax zeigt vom 14.7. bis zum 03.08.2007 eine Stärke von -25 Punkten an, dies stellt eine recht negative Situation dar. Zeitlich liegt das Ziel somit beim 01/02.08.2007

Transitliste nur Dax

26. 5.2007 - 26. 5.2007	4 tr $\angle D$	+	exakt 26. 5
26. 5.2007 - 26. 5.2007	4 tr \square AC	+	exakt 26. 5
2. 6.2007 - 2. 6.2007	2 tr $\times \psi$	+5	exakt 2. 6
12. 6.2007 - 12. 6.2007	4 tr $\circ \psi$	+	exakt 12. 6
12. 6.2007 - 12. 6.2007	2 tr \circ XII		exakt 12. 6
27. 6.2007 - 27. 6.2007	4 tr \circ MC	+/-	exakt 27. 6
14. 7.2007 - 14. 7.2007	2 tr $\pi \circ$	-5	exakt 14. 7
14. 7.2007 - 14. 7.2007	2 tr $\square \psi$	-5	exakt 14. 7
14. 7.2007 - 14. 7.2007	2 tr \angle II	-	exakt 14. 7
14. 7.2007 - 14. 7.2007	2 tr \square VIII	-	exakt 14. 7
22. 7.2007 - 22. 7.2007	2 tr $\angle \circ$	-5	exakt 22. 7
22. 7.2007 - 22. 7.2007	2 tr $\square \delta$	-	exakt 22. 7
3. 8.2007 - 3. 8.2007	2 tr $\square \psi$	-10	exakt 3. 8
17. 8.2007 - 17. 8.2007	ψ tr \circ XII	-	exakt 17. 8

Zusammenfassend können wir festhalten, dass wir auf Tagesbasis ab dem 13.07.2007 folgende Unterstützungen für einen Short-Trade hatten:

- 1.) Fallender Cosmo-Chart ab 16.07.2007
- 2.) Ein Range-Short-Signal ab 13.07.2008 auf Schlusskursbasis mit Ziel unteres Bollinger-Band bei ca. 7830 Punkten. Der 14.+15.07.2007 war übrigens ein Wochenende.
- 3.) Wir hatten somit eine Erwartungshaltung für fallende Kurse.
Das Mindestziel wäre die Marke von 7830 = untere Range-Begrenzung gewesen.

Der Dax erreichte am 24.07.2008 das untere Bollinger-Band. An diesem Punkt hätte man die Entscheidung für einen Verkauf auf Schlusskursbasis treffen können. Da das Tief des Cosmo-Charts und die großen negativen Auslösungen erst Ende Juli stattfanden, hätte man eine Teilposition verkaufen und den Rest mit engen Stopps absichern können.

Wenn man am unteren Bollinger-Band eine Verkaufsentscheidung auf Schlusskursbasis getroffen hätte, dann wäre die Put-Position am Folgetag bei Markteröffnung zu 7752 verkauft worden. Der Gewinn hätte 348 Punkte betragen. Anbei nochmals der Realchart.



Übrigens entstand genau einen Tag nach dem Ende des Range-Short-Signals ein Trend-Short-Signal und man hätte in Kombination mit der Astro einen neuen Trade eröffnen können, dieses Beispiel werde ich hier aber nicht mehr erläutern, da es mir in diesem Dokument ausschließlich um das Basisprinzip geht und dieses wurde ausführlich erklärt. Das Trend-Short-Signal hätte bis 02.08.2007 weitere 230 Punkte Gewinn mit sich gebracht.

Über das Chance-/Risiko-Verhältnis, die Positionsgrößenbestimmung und die Größe von R:

Das Chance-/Risiko-Verhältnis ist wirklich sehr bedeutend, denn angenommen man wird bei 3 Trades mit einem CRV von 3 zu 1 ausgestoppt und macht jedesmal 1.000,- Euro Verlust, dann braucht man nur einen Gewinn-Trade, um die Verluste wieder aufzuholen. Bei einer Trefferquote von 40% und einer Verlustquote von 60% würde die Rechnung bei 10 Trades wie folgt aussehen. 6 x 1.000,- Euro Verlust durch „ausgestoppt werden“ = 6.000,- Euro Verlust. 4 x 3.000,- Euro Gewinn bei CRV von 3 zu 1 = 12.000,- Euro Gewinn. 12.000,- Gewinn minus 6.000,- Euro Verlust = 6.000,- Euro Gewinn.

Sehr wichtig bei diesem Gedanken ist auch die Positionsgrößenbestimmung und die Größe von R.

R ist unser Maximalverlust pro Trade. Er beträgt in Zukunft beim Daily-Trading für das Cosmo-Trend-Musterdepot 1.000,- Euro pro Trade = bzw. 1,0% vom Musterdepotwert. Die Positionsgrößenbestimmung und die Größe „R“ sollen uns vor einem Kapitaltotalverlust schützen.

Stellen Sie sich folgendes vor: Beim oben erwähnten Trade lag das Risiko bei 70 Dax-Punkten. 1.000,- Euro geteilt durch 70 ergibt 14,28 Euro. Wenn wir einen Dax-Future handeln würden, dann läge unser Risiko bei $70 \times 1 \times 25,- \text{ Euro} = 1750,- \text{ Euro}$, was 1,75 R entsprechen würde. Dies liegt über unserem Rahmen von 1 R. 1 Punkt beim Dax-Future hat den Wert von 25,- Euro. Besser wäre, wenn wir für die Umsetzung CFDs verwenden würden. 1 Dax-CFD bei <http://www.cmcmarkets.de/> ist 1,- Euro wert. 25 Dax-CFDs entsprechen somit einem Dax-Future. Das Gute an CFDs ist, dass wir die Positionsgröße exakt einem „R“ entsprechend gestalten können. 14,28 CFDs würden bei einem Risiko von 70 Punkten einen Wert von ca. 1000,- Euro ergeben: $70 \times 14,28 \text{ Dax-CFDs} = 1.000,- \text{ Euro}$. Da man 0,28 CFDs nicht kaufen kann, müsste man entweder 14 oder 15 CFD nehmen.

Wenn Ihr Trading-Konto nur eine Größe von 10.000,- Euro hat, dann würde 1R = 100,- Euro sein. Sie könnten in diesen Falle nur 1,428 CFDs kaufen, abgerundet 1 Dax-CFD, aufgerundet 2. Dieser Punkt ist sehr wichtig, denn wenn Sie 10.000,- Euro auf dem Konto haben und die gleiche Positionsgröße wie das Cosmo-Trend-Musterdepot eingehen, dann ist die Gefahr eines Totkapitalverlustes einfach zu groß.

Cosmo-Trend wird das Daily-Trading nicht nur mit dem Dax-Future oder Dax- bzw. Aktien-CFDs aufführen, sondern bei Bedarf auch Optionsscheine, Eurex-Optionen oder Hebelzertifikate verwenden, je nach Situation. Der maximale Verlust soll hier aber auch bei 1 R liegen. 1 R, beim Cosmo-Trend-Musterdepot ist im Moment = 1.000,- Euro = 1% vom Kapital ist eine Idealzahl. Man muss immer einmal damit rechnen, dass man ein Open-Gap in die falsche Richtung erwischt und dadurch ein vielfacher Verlust von 1R entsteht, gleiches wird aber auch in die gewünschte Richtung passieren.

Nochmalige Kurzdefinition von Cosmo-Trend-Daily-Trading:

Cosmo-Trend Daily-Trading ist eine Kombination von Charttechnik und Astrologie.

Wichtige Elemente:

- 1.) Charttechnisches Handelssignal in eine Richtung z.B. Long/Short.
- 2.) Gehandelt werden Range- und Trendsignale.
- 3.) Astrologische Bestätigung der gehandelten Richtung.
- 4.) Zielbestimmung in Punkten über charttechnische Punkte wie Widerstände/Unterstützungen, Bollinger-Bänder und Zielzonen von astrologischen Preis-/Zeit-Verhältnissen.
- 5.) Einstieg/Ausstieg in Tagessignalrichtung am Folgetag bei Markteröffnung oder per Kauf- bzw. Verkaufslimit.
- 6.) mit einem Chance-/Risiko-Verhältnis von mindestens **3 zu 1**.
- 7.) Das maximale Risiko pro Trade sollte im Idealfall maximal 1% des Kapitals betragen. Ein höherer Verlust kann nicht ausgeschlossen werden.

Was ist das Ziel von Cosmo-Trend-Daily-Trading?

- 1.) Im Cosmo-Trend-Daily-Trading werden hauptsächlich der Dax, der S+P 500, Gold und sekundär auch der Hang-Seng-Index, der Nikkei-Index, Devisen und Dax-Schwergewichte (im Moment 10 Werte) gehandelt.
- 2.) Die eben genannten Werte werden täglich gescannt und nach Kauf- bzw. Verkaufssignalen durchsucht.
- 3.) Ziel ist es, innerhalb von einem Jahr möglichst viele Trades ausführen zu können. 30-50 Trades wären ideal. Je mehr desto besser. Anbei gehe ich von 40 Trades pro Jahr aus.
- 4.) Das Potenzial könnte bei einer 40%igen Trefferquote und bei einem CRV von **3 zu 1** wie folgt berechnet werden:
Verliererquote 60% = 24 Trades x 1.000,- Euro Verlust = 24.000,- Euro Verlust
Gewinnerquote 40% = 16 Trades x 3.000,- Euro Gewinn = 48.000,- Euro Gewinn.
Gewinn abzüglich Verlust = 24.000,- Euro = 24% Performance auf 100.000,- Euro Kapital.
- 5.) Diese Berechnung ist sehr grob, da in der Realität auch des Öfteren niedrigere/höhere Gewinne und niedrigere/höhere Verluste auftauchen werden.
- 6.) Ich denke schon, dass das Performanceziel von 20% Plus realistisch ist und bei einer Trefferquote von nur 40% wurde auch genug Platz für Fehlentscheidungen eingeplant.

Welche Bereitschaft müssen Sie mitbringen?

- 1.) Die Daily-Trading-Signale werden jeden Morgen ab 8:50 Uhr auf der Seite <http://www.cosmo-trend.com/Kunden-Login/Login-Kunden.html> und per Email veröffentlicht. Sie müssen somit die Bereitschaft mitbringen, die genannte Seite bzw. Ihre Emails einmal täglich gegen 8.50 Uhr zu lesen. Die Daily-Signale von Cosmo-Trend werden nicht als SMS versandt.
- 2.) Die Signale bzw. Kauf- und Verkaufsmittelungen werden nur in Kurzform mitteilt, sprich ohne Graphik.
- 3.) Sie müssen die Bereitschaft haben, Ihren Broker/Bank anzurufen, um die Order zu platzieren oder dies persönlich über den PC erledigen.
- 4.) Sie müssen die Bereitschaft haben, längere Verlustserien zu ertragen.
- 5.) Sie müssen bereit sein einen Draw-Down von 15-20% Ihres Kapitals zu ertragen. Der Begriff Drawdown bezeichnet den maximalen Wertverlust bis zur Wiedererreichung des Ursprungswertes.
- 6.) Sie müssen zumindest ein Konto bei einem CFD-Broker und bei einem Discount-Broker haben. Cosmo-Trend-Empfehlung: <http://www.emcmarkets.de/> für CFDs und Cortal-Consors <https://www.cortalconsors.de> für Dax-Futures, Optionsscheine, Eurex-Optionen und Hebelzertifikat. Bei Cortal-Consors brauchen Sie ein extra Eurex-Unterkonto.
- 7.) Sie müssen es einfach wollen.

Mit freundlichen Grüßen

Henning P. Schäfer

Risikohinweis: Alle Ausarbeitungen und Analysen beim Cosmo-Trend-Dax-Trading sind nach bestem Wissen und Gewissen gemacht worden. Für deren Nichteintreffen kann jedoch keine Haftung übernommen werden. Gemachte Empfehlungen für Futures, Optionsscheine, Turbo-Zertifikate und sonstige Hebelprodukte stellen unsere Meinung dar, für die Umsetzung der Empfehlungen trägt jedoch jeder seine eigene Verantwortung. Jeder muss sich bewusst sein, dass es sich hier um spekulative Börsengeschäfte handelt. Für Verluste kann keine Haftung übernommen werden. Alle Rechte der Verbreitung vorbehalten, ebenfalls für elektronische und fotomechanische Wiedergabe.