

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-Swing-Trading

Sehr geehrte Leserinnen und Leser,

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

Ein Swing-Trade ist ein Trade (Handel), der während eines Handelstages eröffnet (intraday) und dann in der Regel am Folgetag oder später geschlossen wird. Während beim reinen Intraday-Trading alle Positionen vor Marktschluss glattgestellt werden, können Swing-Trades auch über den Zeitraum von ein paar Tagen gehalten werden. Da man auch ausgestoppt werden kann, oder eine sehr schnelle Bewegung zum Ziel führt, muss ein Swing-Trade nicht zwingend über Nacht gehalten werden, aber in der Planung wird dies meistens der Fall sein. Die Dauer eines Swing-Trades kann dementsprechend von einer Minute bis zu mehreren Wochen Zeit in Anspruch nehmen, in der Regel sollte ein Trade bei einem zugrundeliegenden 30-Minuten-System zwischen ein paar Stunden und ein paar Tagen dauern. Im nachfolgenden Beispiel möchte ich kurz erklären, wie ich Swing-Trading in Zukunft für das Cosmo-Trend-Musterdepot einsetzen werde.

Inhalt:

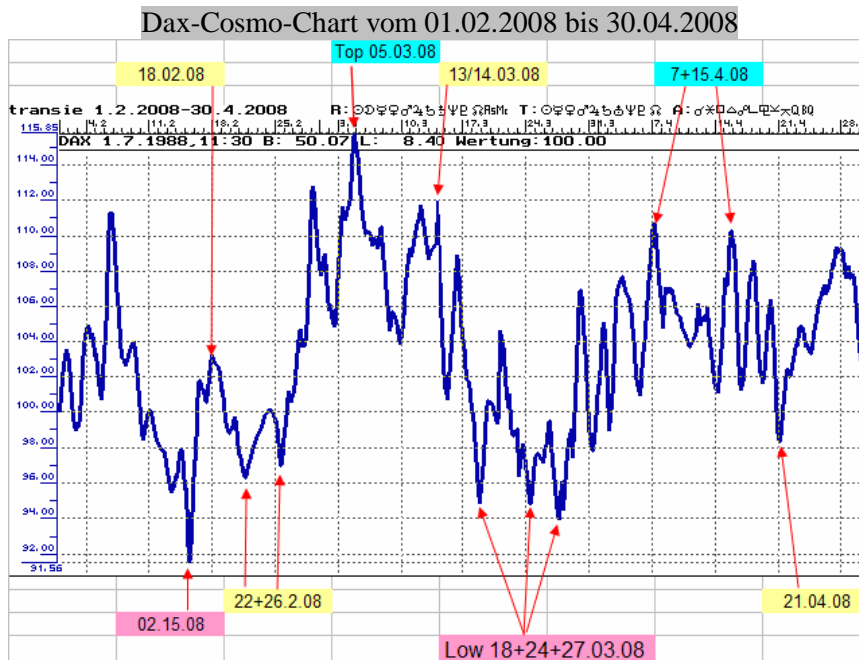
- Seite 1 => Definition Swing-Trading, siehe oben.
- Seite 2-3 => Grundgedanken zur Haupt- bzw. Tagesebene
- Seite 4-5 => Beispiele Swing-Trading
- Seite 6 => Über das Chance-/Risiko-Verhältnis, die Positionsgrößenbestimmung und die Größe von R.
- Seite 6-7 => nochmalige Definitionen, Ziele und Ihre Bereitschaft

Grundgedanken zur Haupt- bzw. Tagesebene:

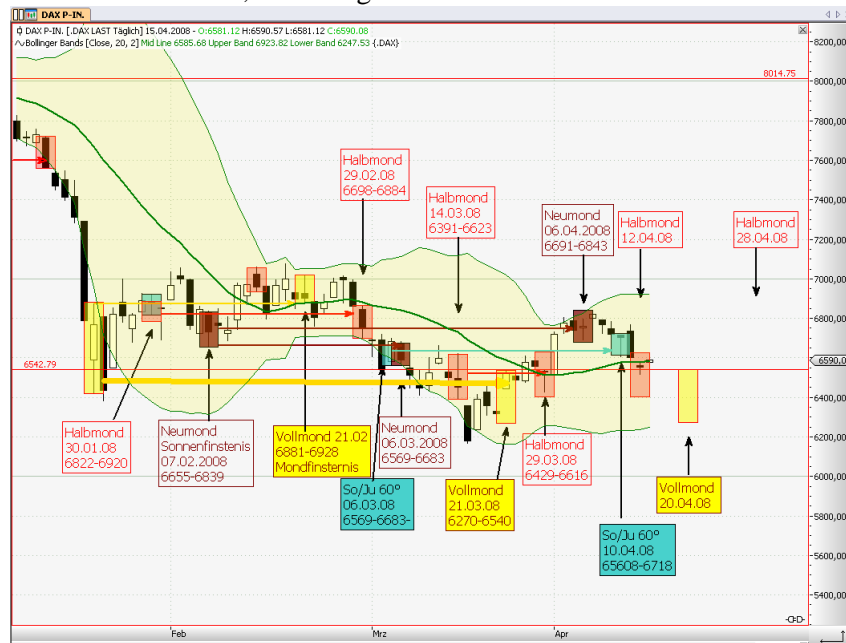
In nachfolgenden Tageschart des Dax habe ich ein Range-Long-Signal nach dem Cosmo-Trend-Handelssystem eingezeichnet. Das Signal wurde am 25.03.2008 auf Schlusskursbasis generiert (siehe roter Pfeil im Chart). Der Dax stand aber an diesem Tag bereits fast an der 20-Tage-Linie und das Chance-/Risiko-Verhältnis war daher nicht mehr besonders gut.



Das obere Bollinger-Band stand am 25.03.2008 bei 7019 Punkten (Tendenz fallend) und das untere Bollinger-Band bei 6161 Punkten. Die Chance nach oben betrug somit 495 Punkte (eher weniger, da das obere Bollinger-Band fallend war). Einen guten Stopp hätte man auf Tagesbasis unter der letzten Doji-Kerze vom 24.03.2008 bei 6250 setzen können und somit hätte das Risiko ca. 274 Punkte betragen. Das Chance-/Risiko-Verhältnis betrug somit auf Tagesbasis ca. **1,8 zu 1**, dies ist kein besonders gutes Verhältnis. **3 zu 1** oder **4 zu 1** sind akzeptable C/R-Verhältnisse (nachfolgend meist CRV genannt). Trotzdem war ab dem 25.03.2008 ein Range-Long-Signal vorhanden und auch der Dax-Cosmo-Chart (siehe folgende Seite) zeigte ab dem 18.03.2008 bis zum 07.04.2008 die Möglichkeit einer Aufwärtsbewegung an. Streng genommen findet die Aufwärtsbewegung im Cosmo-Chart sogar nur vom 27.03.2008 (Orbis 3 Tage) bis zu 07.04.2008 statt. Dazu muss man noch sagen, dass die Aufwärtsbewegung im Cosmo-Chart nur durch kleinere Transite zustande kommt, die mittel- bis langfristigen Transite deuten eher auf einen Seitwärtsmarkt hin. Trotzdem konnte man als Optimist davon ausgehen, dass der Dax bis 07.04.2008 steigen kann, denn auch die Charttechnik hat ja ein Range-Long-Signal generiert. Der Dax markierte übrigens genau am 07.04.2008 sein Top.



Zusätzlich zum steigenden Cosmo-Chart lag uns über die Preis-Zeit-Ebene die Information vor, dass der Dax zum Neumond am 06.04.2008 und zur Sonne/Jupiter-Verbindung am 10.04.2008 eventuell in den Bereich von 6569-6683 steigen könnte. Diese Mindestziele wurden bei beiden Preis-/Zeit-Verhältnissen in der Realität erfüllt, siehe folgender Chart.



Zusammenfassend können wir festhalten, dass wir auf Tagesbasis ab dem 26.03.2008 folgende Unterstützungen für einen Long-Trade hatten:

- 1.) Steigender Cosmo-Chart ab 18.03.2008, eng gefasst vom 27.3. bis 07.04.2008
- 2.) Ein Range-Long-Signal ab 05.03.2008 auf Schlusskursbasis mit Ziel oberes Bollinger-Band bei ca. 7000 Punkten mit fallender Tendenz.
- 3.) Preis-/Zeit-Fenster am 06. und 10.04.2008 im Bereich von 6569-6683 Punkten.
- 4.) Wir hatten somit eine positive Erwartungshaltung für den Dax.

Das Mindestziel wäre die Marke von 6569 gewesen = untere Range-Begrenzung der Preis-/Zeit-Fenster. Das obere Potenzial lag bei 6683 = obere Range-Begrenzung der Preis-/Zeit-Fenster und bei ca. 7000 = oberes Bollinger-Band auf Tagesbasis.

Soweit die Tagesebene.

Beispiel Swing-Trading:

Nachfolgend habe ich einen 30-Minuten-Kerzenchart des Dax erstellt. Dieser Chart zeigt die ganze Aufwärtsbewegung vom 17.03. bis 07.04.2008 auf. Eine Kerze enthält alle Kursinformationen von 30 Minuten. Der blaue Pfeil zeigt den Schlusskurs am 25.03.2008 um 17.30 Uhr, an dem Tag, an dem unser Range-Long-Signal generiert wurde.



Nun beginnt die eigentliche Arbeit:

Wir suchen nun einen Einstieg in unsere Daily-Richtung (hier long), bei dem wir unser Chance-/Risiko-Verhältnis auf ein Level von **3 zu 1** oder noch besser auf **4 zu 1** erhöhen können.

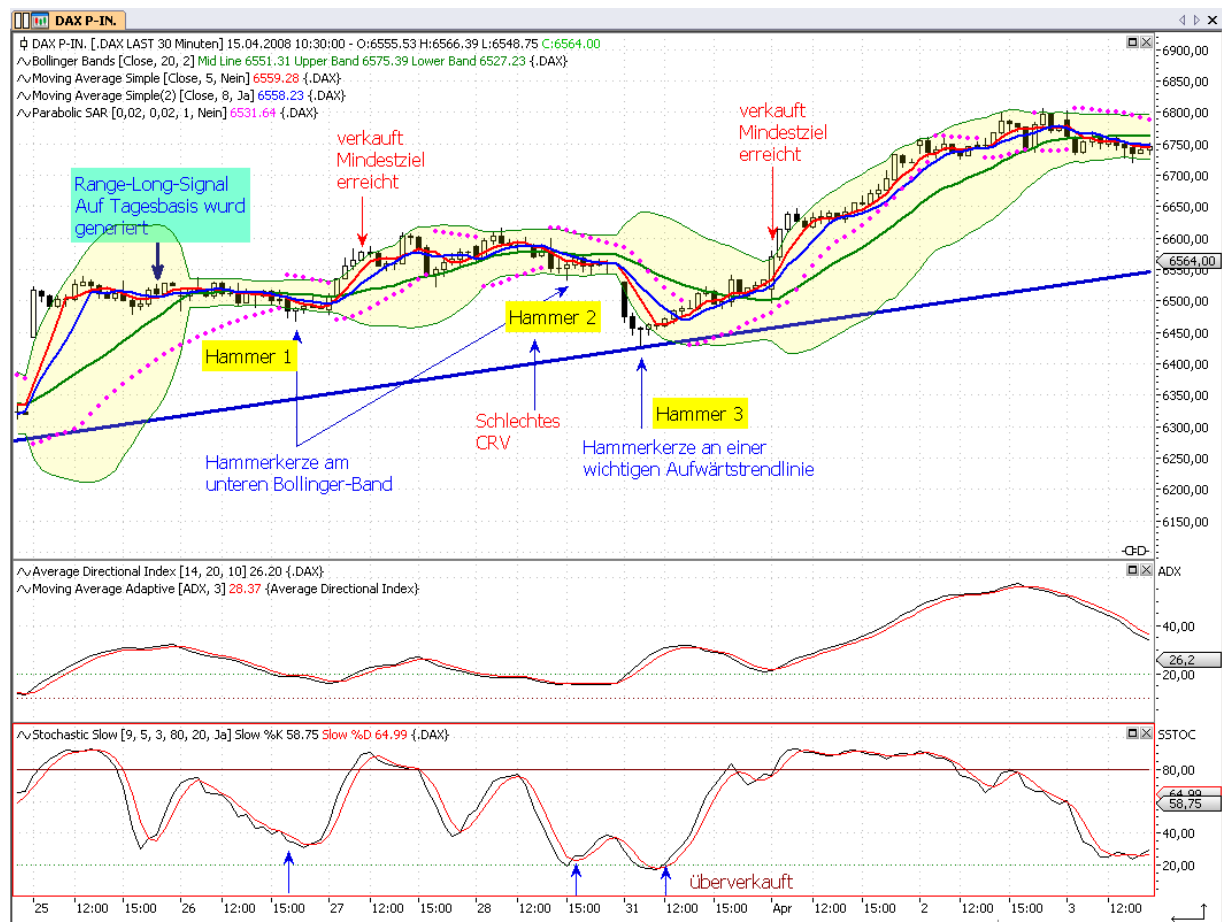
Auf der folgenden Seite wird der 30 Minuten-Chart für die Zeit nach dem Daily-Range-Long-Signal aufgezeigt. Ich nenne diesen Einstieg „konträr“, da wir auf 30-Minutenbasis einen **überverkauften** Zustand suchen, der es uns ermöglicht, nur ein geringes Risiko einzugehen. Handeln möchten wir aber in Tages-Signal-Richtung. Im Chart auf der folgenden Seite habe ich 3 bullische Hammer-Kerzen am unteren 30-Minuten-Bollinger-Band eingezeichnet.

1.) Nach dem ersten Hammer stand der Dax bei der Kerzeneröffnung bei 6489 Punkten. Bis zu unserem Mindestkursziel bei 6569 = untere Range-Begrenzung der Preis-/Zeit-Verhältnisse, sind es 80 Punkte, der Stopp hätte unter dem Hammertief (6469) bei 6465 gesetzt werden können. Chance 80 Punkte, Risiko 24 Punkte = Chance-/Risiko-Verhältnis von **3,3 zu 1**. Dieses CRV liegt in unserem Rahmen. Am folgenden Tag wurde das Ziel bei 6569 Punkten erreicht und nach einem bearischen Shooting Star auf 30-Minuten-Basis hätte man bei Eröffnung der nächsten Kerze zu 6565 verkaufen können. Der Gewinn betrug 76 Punkte. Bei einem Dax-Future hätte der Gewinn 76 x 25,- Euro = 1900,- Euro betragen. Die Trade-Dauer lag bei 7 Kerzen = 3,5 Handelsstunden. Der Trade wurde aber über Nacht gehalten und daher war es ein Swing-Trade und kein Intraday-Trade.

2.) Der zweite Hammer schloss bei 6557 Punkten und somit war zu unserem Mindestkursziel am 06.04. und 10.4.2008 bei 6569 Punkten nur eine Chance von 12 Punkten vorhanden, dieser Trade fällt somit aus.

3.) Der dritte Hammer schloss bei 6455. Die Chance bis 6569 lag somit bei 114 Punkten. Die Position wäre bei der nächsten Kerzeneröffnung bei 6455 eröffnet worden. Der Stopp hätte unter der Hammer-Kerze bei 6420 gesetzt werden können, was einem Risiko von 35 Punkten gleichkommt. Chance 114 Punkte, Risiko 35 Punkte = Chance-/Risiko-Verhältnis von **3,25 zu 1**. Dieses CRV liegt in unserem Rahmen.

Der Trade wäre am folgenden Tag am oberen Bollinger-Band bei 6569 geschlossen worden, der Gewinn betrug somit 114 Punkte. Bei einem Dax-Future hätte der Gewinn $114 \times 25,- \text{ Euro} = 2850,- \text{ Euro}$ betragen. Der Trade dauerte 8 Handelsstunden und wurde über Nacht gehalten. Beim dritten Hammer waren die besten Bedingungen aus charttechnischer Sicht vorhanden. Der Hammer fand auf einer wichtigen Aufwärtstrendlinie statt und der Slow-Stochastik war stark überverkauft.



Die beiden eben aufgezeigten Beispiele waren noch sehr konservativ gerechnet. Betrachten wir uns nochmals die Kursziele.

- 1.) Das Mindestziel wäre die Marke von 6569 gewesen = untere Range-Begrenzung der Preis-/Zeit-Fenster.
- 2.) Das obere Potenzial lag bei 6683 = obere Range-Begrenzung der Preis-/Zeit-Fenster
- 3.) und bei ca. 7000 = oberes Bollinger-Band auf Tagesbasis.

Hätte man die Mitte der unteren Range-Begrenzung bei 6569 und dem oberen Bollinger-Band bei 7000 (= 6784 Punkte) genommen, dann wäre beim ersten Hammer (6489) eine Chance von 295 Punkten vorhanden gewesen. Bei einem 74 Punkte-Stopp wäre das CRV bei 4 zu 1 gelegen. Der Stopp hätte gehalten, das Ziel wäre erreicht worden.

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 Swing-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 ersten oben erwähnten Trade lag das Risiko bei 24 Dax-Punkten. 1.000,- Euro geteilt durch 24 ergibt 41,66 Euro. Wenn wir 2 Dax-Future handeln würden, dann läge unser Risiko bei 24 x 2 x 25,- Euro = 1200,- Euro, was 1,2 R entsprechen würde. Dies liegt noch im Rahmen. 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. 41 CFDs würden bei einem Risiko von 24 Punkten einen Wert von ca. 1000,- Euro ergeben: 24 x 41,66 Dax-CFDs = 1.000,- Euro. Da man 0,66 CFDs nicht kaufen kann, müsste man entweder 41 oder 42 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 4,166 CFDs kaufen, abgerundet 4 Dax-CFDs. 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 Totalkapitalverlustes einfach zu groß.

Cosmo-Trend wird Swing-Trades nicht nur mit Dax-Futures oder Dax-CFDs durchführen 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.

Wie ist die Definition von Cosmo-Trend-Swing-Trading?

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

Wichtige Elemente:

- 1.) Charttechnisches Handelssignal auf Tagesebene in eine Richtung z.B. Long/Short.
- 2.) Astrologische Bestätigung der gehandelten Richtung.
- 3.) Zielbestimmung in Punkten über charttechnische Punkte wie Widerstände/Unterstützungen, Bollinger-Bänder und Zielzonen von astrologischen Preis-/Zeit-Verhältnissen.
- 4.) Konträrer **(entgegengesetzter)** Einstieg in Tagessignalrichtung auf 30-Minutenbasis
- 5.) mit einem Chance-/Risiko-Verhältnis von mindestens **3 zu 1**.
- 6.) Das maximale Risiko pro Trade sollte im Idealfall maximal 1% des Kapitals betragen. Ein höherer Verlust kann nicht ausgeschlossen werden.
- 7.) Die Tradedauer sollte im Idealfall zwischen 2 Stunden und 2-5 Tagen dauern.

Was ist das Ziel des Cosmo-Trend-Swing-Tradings:

- 1.) Wir bekommen hierdurch mehr Signale und mehr Chancen. Dadurch sollte sich die jährliche Performancekurve verbessern und glätten. Zusätzlich werden ja über den Kunden-Login bzw. per Email noch Signale auf Tagesschlusskursbasis für mehrere Werte veröffentlicht und gehandelt.
- 2.) Ich könnte mir vorstellen, dass im Laufe eines Jahres ca. 40 Dax (35-45) Swing-Trading-Signale gehandelt werden können, dies entspräche ca. 3-4 Signalen im Monat.
- 3.) Ich kann auch nicht jeden Tag auf Signale lauern, da ich manchmal andere Dinge zu tun habe, daher wird es das Swing-Trading nur phasenweise geben.
- 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 SwingTrading-Signale wird es vorerst nur für den Dax gegen, später eventuell für 1-2 Werte mehr.
- 2.) Die Signale werden per SMS versandt. Sie müssen somit die Bereitschaft haben, Ihr Handy bei sich zu tragen und dies während des Handelstages = Montag bis Freitag von 8-22.00 Uhr. Einstiegssignale wird es nur in der Zeit von 8.00 bis 17.00 Uhr geben, Ausstiegssignale je nach Bedarf. Ich werde die Signale auch per Email versenden, die SMS ist aber ausschlaggebend für die Abrechnung.
- 3.) Sie müssen die Bereitschaft haben, direkt nach dem Erhalt der SMS 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 Draw-Down 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.cmcmarkets.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 für den Dax-Future und die Eurex-Optionen.
- 7.) Sie müssen es einfach wollen.

Mit freundlichen Grüßen

Henning P. Schäfer

Alle Charts im Börsenbrief wurden mit der Software Tradesignal erstellt. Mehr Infos: www.tradesignal.com

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.