

Disclaimer

Börsegeschäfte sind mit erheblichen Risiken verbunden. Wer an den Finanz- und Rohstoffmärkten handelt, muss sich zunächst selbstständig mit den Risiken vertraut machen. Die vorgestellten Analysen, Techniken und Methoden stellen keine Einladung zum Handel auf den Finanz- und Rohstoffmärkten dar. Sie dienen lediglich der Veranschaulichung sowie der Fortbildung und Information und stellen keine Anlageberatung oder sonstige individuelle Empfehlung dar. Sie sollen lediglich eine unabhängige Investitionsentscheidung des Kunden erleichtern und ersetzen keine Anleger- und Anlageberatung. Dennoch handelt der Kunde auf eigenes Risiko und eigene Gefahr.

[CHARTSEKTE.DE/HAFTUNGSAUSSCHLUSS/](https://chartsekte.de/haftungsausschluss/)



Sonntag, 15.11.2020

Webinar

STAFFEL 1, EPISODE III

CHARTSEKTE.DE



Themen



EIN BISSCHEN RMM BASICS



MARKET WATCH



Q&A

FIXED RISK RATIO

Das **Verlustrisiko/ Trade** wird als **fester Prozentsatz** auf des Handelskontos definiert.

Die **maximale Positionsgröße** wird so gewählt, dass bei einem SL-Hit maximal $XX\%$ des Kontostandes als Verlust realisiert werden.

Mit wachsendem Kontostand kann mit größeren Positionsgrößen gehandelt werden. Der Zinsseszins wird vor allem in Marktphasen erhöht, in denen die Handelsstrategie besonders viele Treffer hat.

SLOW DOWN YOUR **DRAW** DOWN



Loss

-10%
-20%
-30%
-40%
-50%
-60%
-70%
-80%
-90%
-95%

Recovery needed

+11%
+25%
+43%
+67%
+100%
+150%
+233%
+400%
+900%
+1900%

10.000€ Trading Kapital

1 Aktie = 100€

Verlust / Aktie bei SL = 5€

10%

1% = 100€

Anzahl Aktien 1% = 20

2% = 200€

Anzahl Aktien 2% = 40

....

.....

5%

1 Aktie = 100€

Verlust / Aktie bei SL = 2,50€

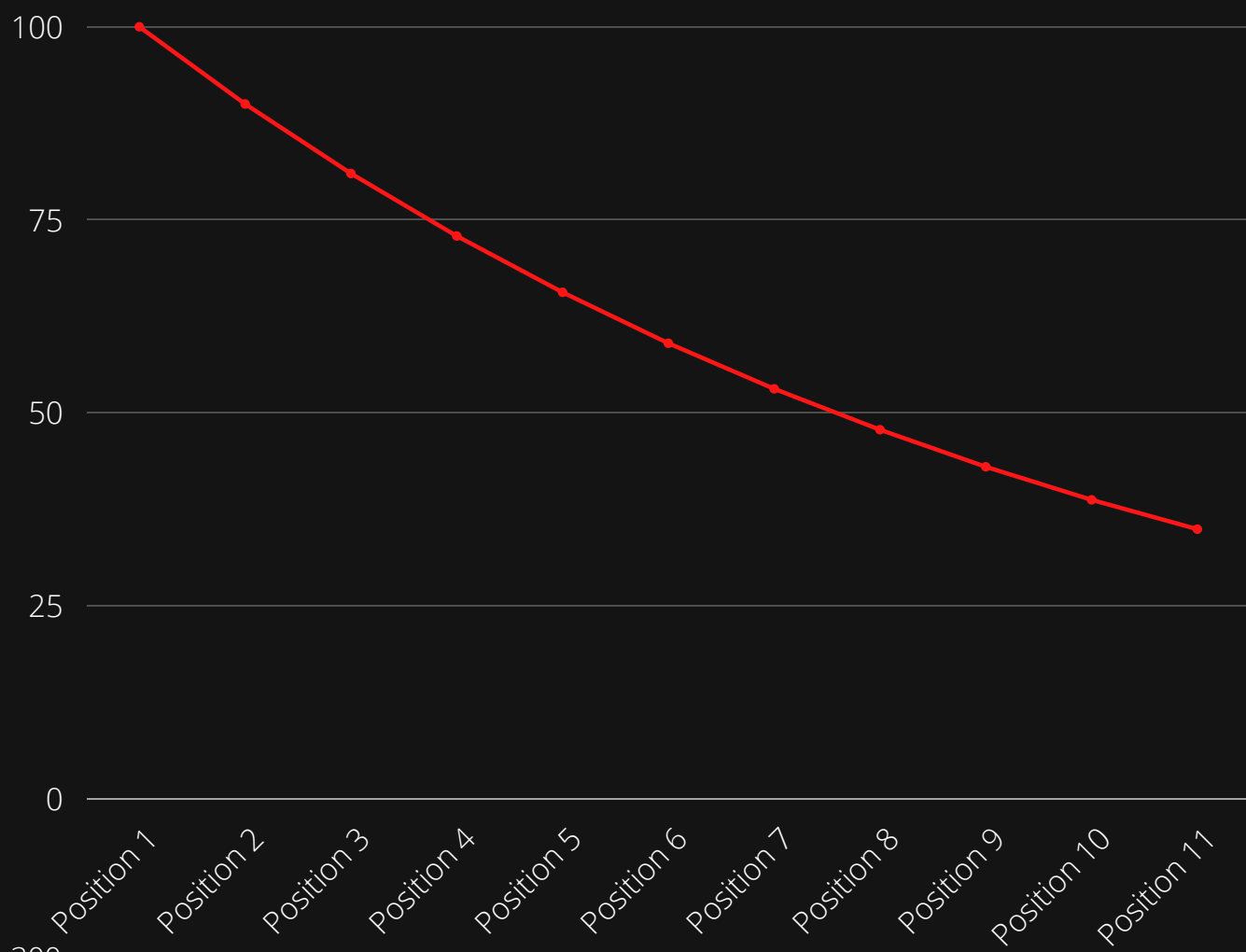
10%

Anzahl Aktien 1% = 40

Anzahl Aktien 2% = 80

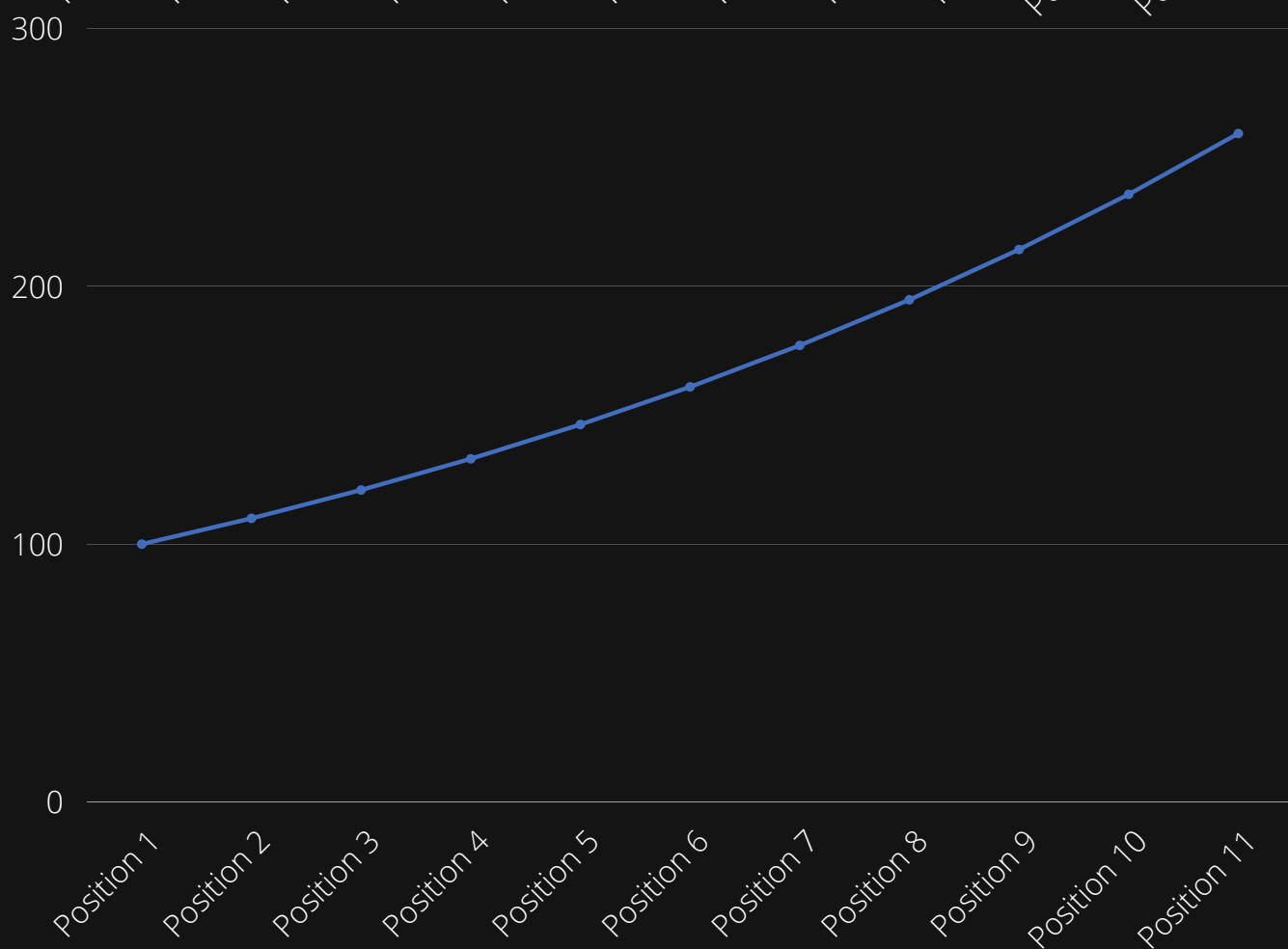
.....

2.5%



Verlustkurve eines Kontos mit Fixed Risk-Ratio in einer Drawdown Phase.

Der absolute Wert des Prozentsatzes kann z.B. am Ende jeder Woche, oder nach dem Schließen eines Trades aktualisiert werden.



Wachstumskurve eines Kontos mit Fixed Risk-Ratio in einer Gewinnphase

Der Prozentsatz kann auf den **Kontostand** (konservativer), oder auch auf die **Equity** angewendet werden bei offenen Buchgewinnen. Wobei letzteres riskanter ist, vor allem bei vielen offenen Positionen.

Wie man Sicherheitsmargin, Ordergebühren oder den Spread beim Einstieg mit in das Risikomanagement einbezieht

Ich meine zum Beispiel wenn du ja einen Trade startest und 2.000€ im Depot hast, davon aber mit Eröffnung 1.000€ als Sicherheitsmargin hinterlegen musst, dann hast du das Risiko auf die verbleibende Margin ja mal eben verdoppelt

Oder wenn der Spread so groß ist, dass er signifikante Auswirkungen auf den Einstieg hat

Wenn die Sicherheitsmargin schon so groß ist, dass ich im Fall eines negativen Trades sofort über dem eigenen Limit wäre, dann dürfte ich den ja nach dem Grundsätzen der 1%-Regel gar nicht erst eröffnen