



Mythos Handelssystem

oder...

wie ich lernte, den Stopp zu
lieben!

Frankfurt, 16.11.2007

Urban Jäkle

- Systematischer Futures-Trader
- Hedge Fund Advisor
- Autor im Magazin TRADERS'
- Sprecher auf europäischen Trading-Events

„Gelernter“ Beruf: Physiker

Mehr Infos:

www.emiliotomasini.com

Mail: jaekle@emiliotomasini.com

Wohin mit dem Stopp?





Wohin mit dem Stopp?



Wohin mit dem Stopp?



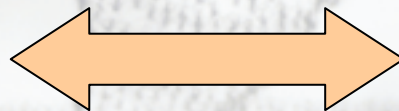
... wie ich lernte, den Stopp zu lieben!

Einstiege: Spannend, immer anders, vielfältig...

Bsp.: Ausbruch, Trendfolge, statistischer Zugang, Zeit, Nachrichten etc.

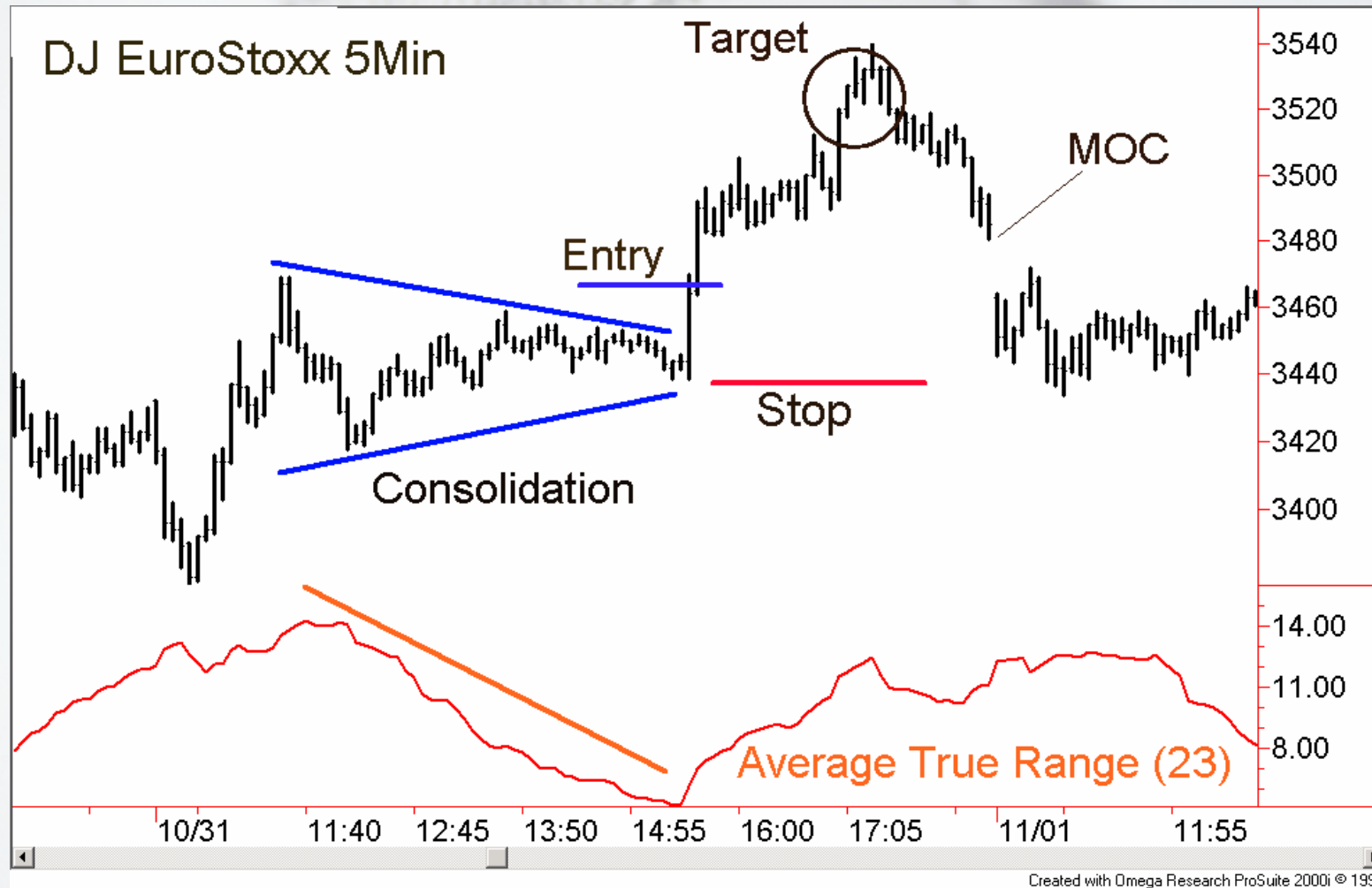
Ausstiege: Lästige Pflicht

Ausstieg

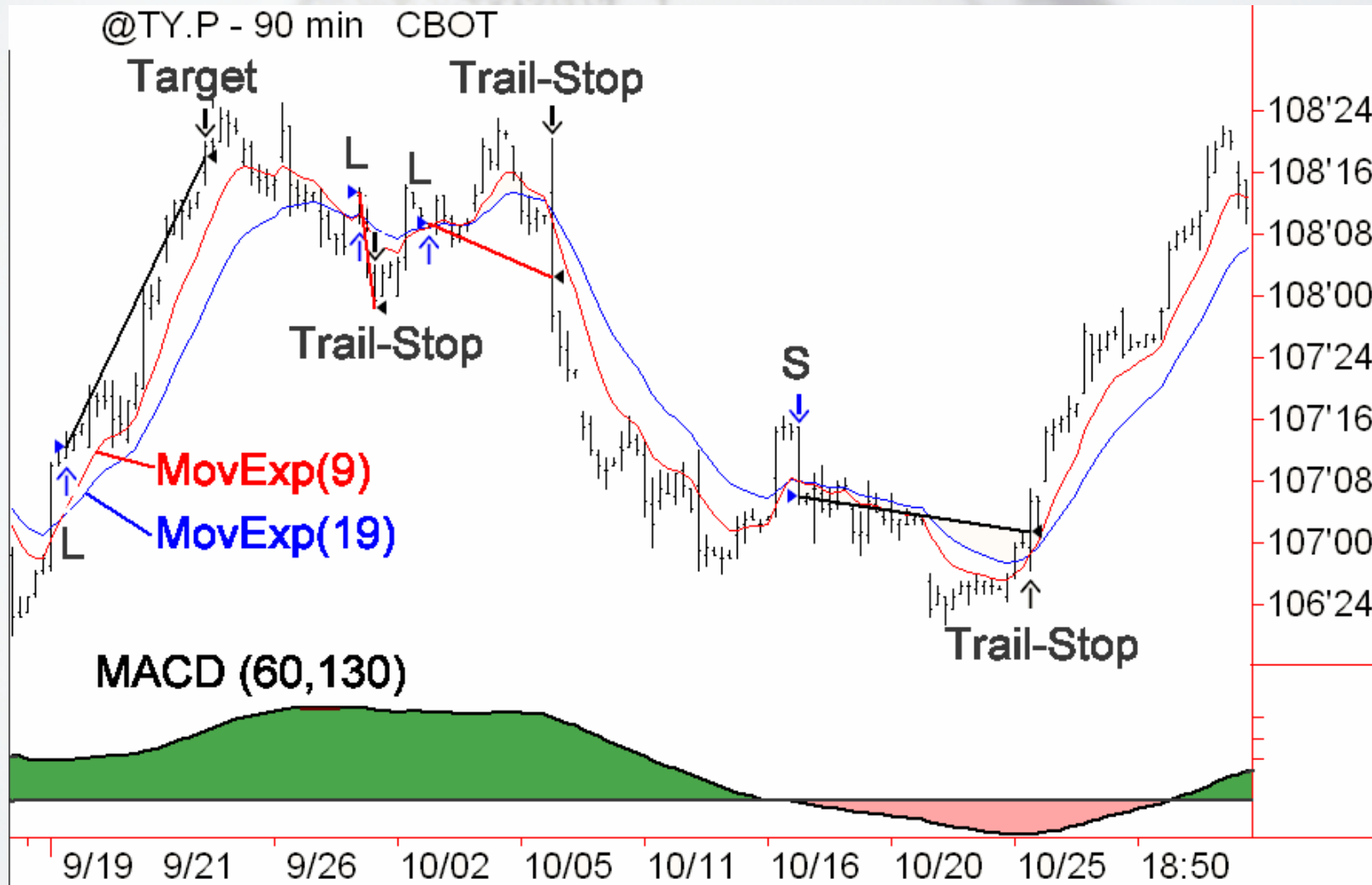


Einstieg

Einstiege I: Ausbruch



Einstiege II: Trendfolge



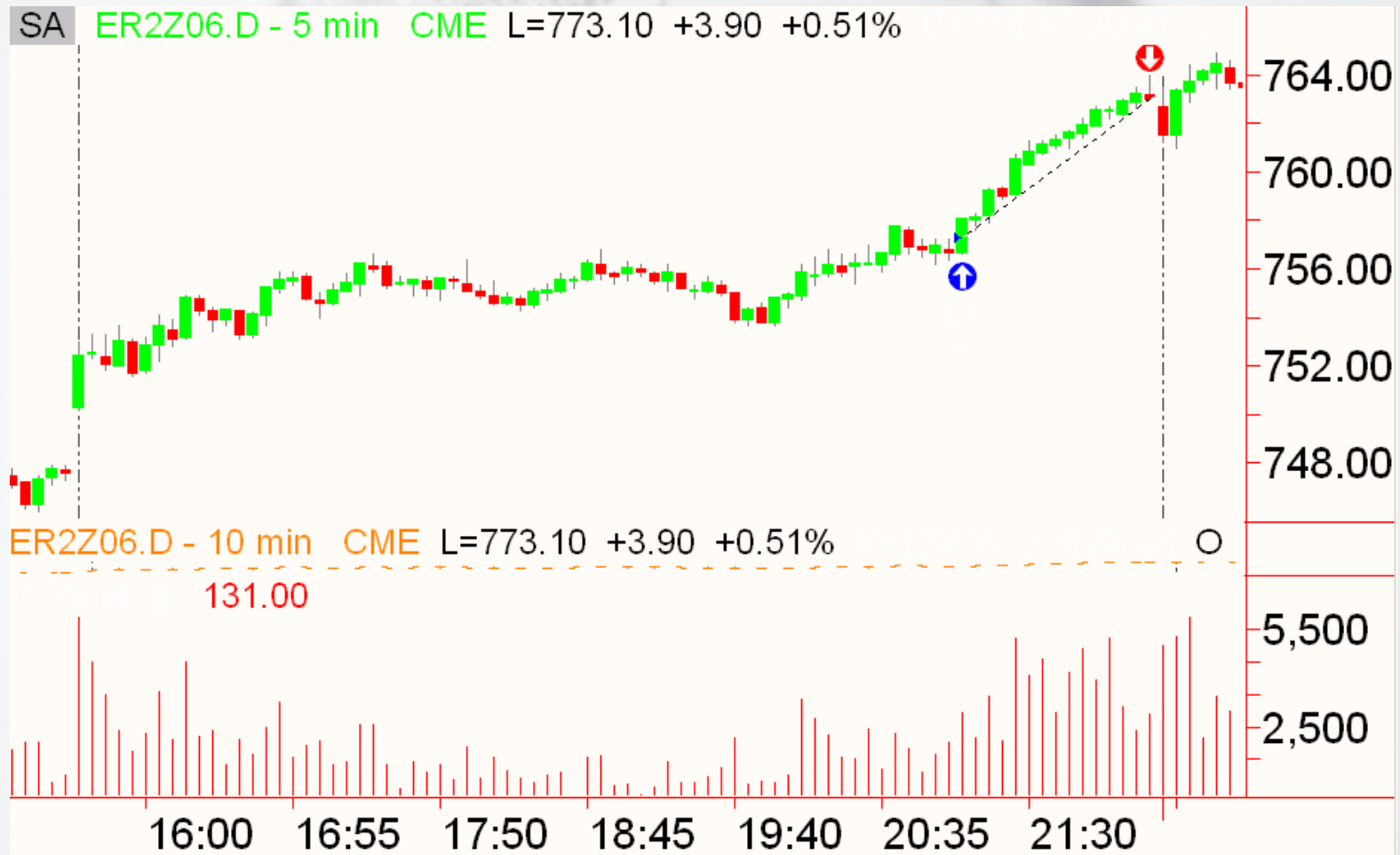
Einstiege II: Statistische Muster

	pct1:=0.28; pct2:=0.6; Range:=Ref(H,-1)-Ref(L,-1); Volabedingung:=Ref(ATR(1),-1)<Ref(ATR		pct1:=0.28; pct2:=0.6; Range:=Ref(H,-1)-Ref(L,-1); Volabedingung:=Ref(ATR(1),-1)<0.7*Ref		pct1:=0.28; pct2:=0.6; Range:=Ref(H,-1)-Ref(L,-1); Volabedingung:=Ref(ATR(1),-1)<0.6*Ref		pct1:=0.28; pct2:=0.6; Range:=Ref(H,-1)-Ref(L,-1); Volabedingung:=VoVuDo									
	Profit	Trades	Profit per Trade	Profit	Trades	Profit per Trade	Profit	Trades	Profit per Trade	Profit	Trades	Profit per Trade	Profit	Trades	Profit per Trade	
D_CAC40 (M	2467	1580	1.5	634	623	1.0	333	293	1.1	2071	600					
D_DAX	7067	1441	4.9	2454	528	4.6	1510	250	6.0	3804	643					
D_ESTX50					25	8.5	1041	104	10.0	2603	267					
D_IBEX35					90	7.4	2577	236	10.9	1602	487					
D_DJIA					01	-0.5	1018	137	7.4	2546	330					
D_Nasdaq10					78	4.9	721	130	5.5	527	349					
D_Nikkei225	57300	1571	3.6	27800	652	4.3	15770	343	4.6	21196	631					
D_S&P500	1186	2602	0.5	469	1109	0.4	207	573	0.4	649	1233					
D_MIB30	42090	1078	3.9	18315	397	4.6	4324	195	2.2	18751	471					
D_FTSE100,	4487	2208	2.0	1010	817	1.2	267	387	0.7	2156	908					
D_Topix*	4104	1424	2.9	1868	582	3.2	1453	333	4.4	1518	513					
D_HangSeng	36900	1804	2.0	20634	808	2.6	13710	438	3.1	15189	741					
D_JSE					69	4.1	1696	435	3.9	303	507					
D_SMI					08	6.2	2235	294	7.6	3142	445					
D_Bobl					45	2.9	13.7	324	4.2	10.7	623					
D_Bund					21	4.8	21.5	323	6.7	20.1	677					
D_Euribor					52	1.9	0.5	525	1.0	2.55	761					
D_T-Bond					83	6.4	31.7	702	4.5	77.8	1328					
D_T-Note (10					79	3.8	30.9	661	4.7	44.4	1075					
D_JapBnd10					29	6.2	17	339	5.0	37.8	609					
D_LongGilt8					08	5.6	32.9	539	6.1	54.9	1093					
D_Aus\$*					80	2.2	12.7	593	2.1	2.1	641					
D_Can\$*					90	2.4	22.9	803	2.9	23.7	1345					
D_Brit. Poun					95	10.5	112	1034	10.8	91	1503					
D_EuroFX da	161.4	2958	5.5	100	1515	6.6	73	950	7.7	80.1	1386					
D_JapYen(C	45.7	2728	1.7	40.8	1548	2.6	26.6	1082	2.5	26.4	1306					
D_SwissFrac	125.8	3070	4.1	73.6	1541	4.8	53.4	913	5.8	64.9	1494					
D_Light Cru	102.5	2257	4.5	53.2	1037	5.1	33.8	577	5.9	55	1057					
D_Natural G	15.6	1365	1.1	7.8	696	1.1	6.2	422	1.5	7.6	648					
D_Coffee	994	3192	3.1	584	1583	3.7	372	949	3.9	453	1529					
D_Copper	513	3967	1.3	180	1815	1.0	98.7	972	1.0	194	1550					
D_Gold	1164	3236	3.6	793	1752	4.5	548	1131	4.8	581	1573					
		2000	3.42		921	4.02		531	4.66		885					
ter	STC_break_gesamt(Aug05)			STC_break_gesamt(Aug05) 0.7			STC_break_gesamt(Aug05) 0.6			STC_break_gesamt(Aug05) \						
		sehr viele Trades!			0.7-Bed bring	17.7%		0.6-Bed bring	36.2%		VoVuDo-Bed					

Profit per Trade

Testing all markets with same parameters

Einstiege IV: Zeit



Dynamik der Ausstiege

Reverse

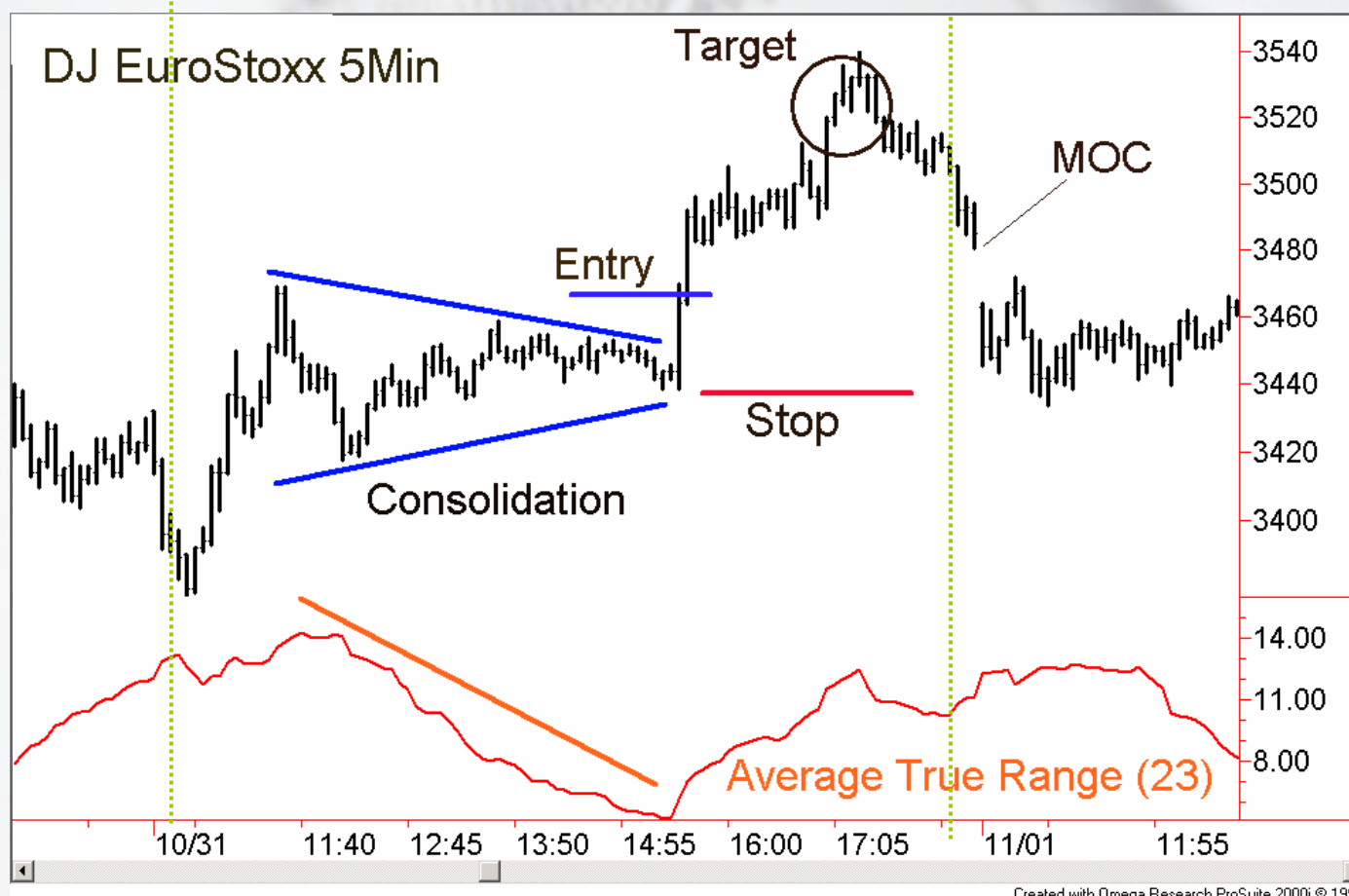
Entry

Exit

Exits \leftrightarrow Entries:

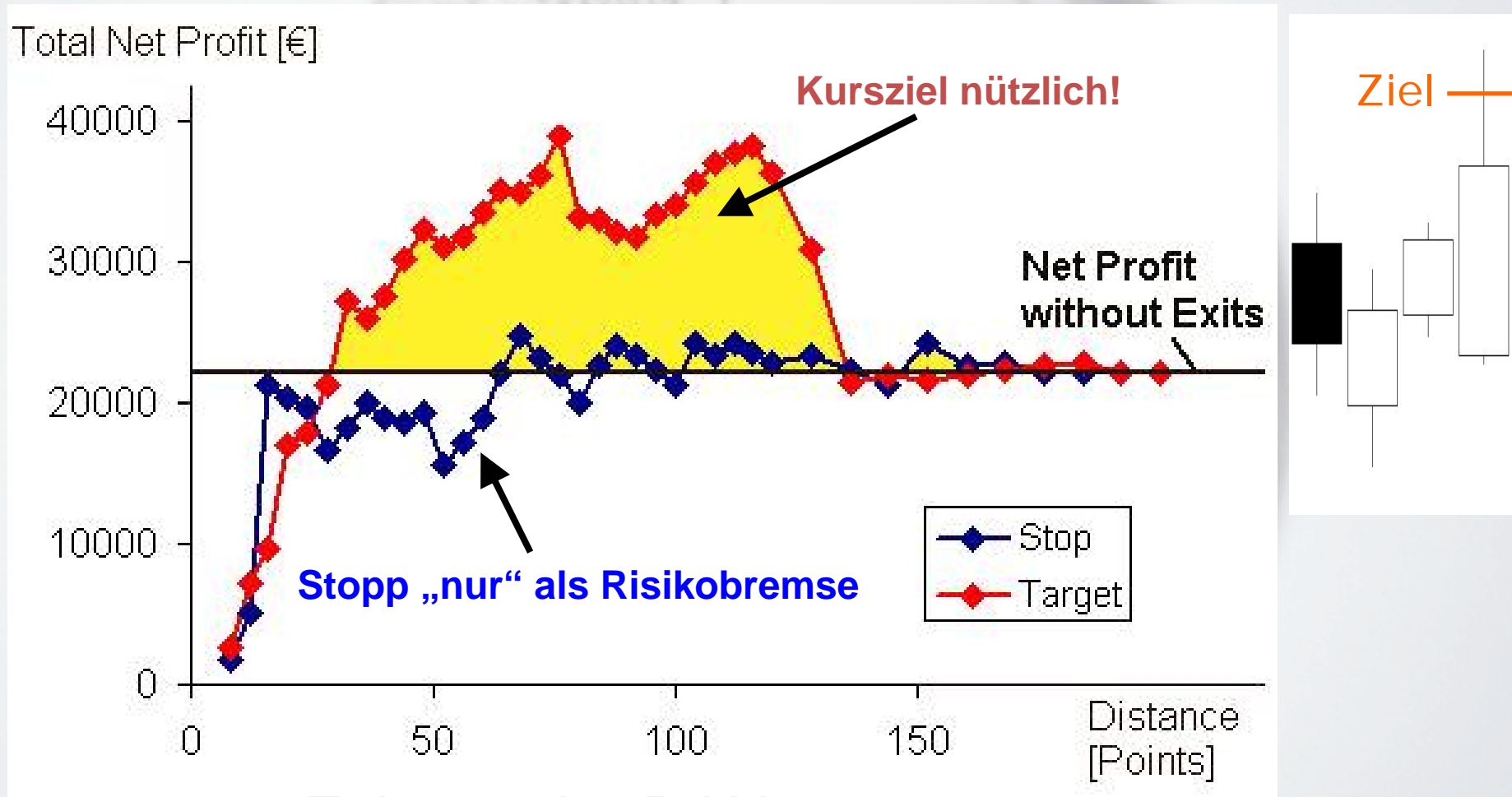
NO RANDOM ENTRIES!!!

Ausstiege für ein Daytrading System



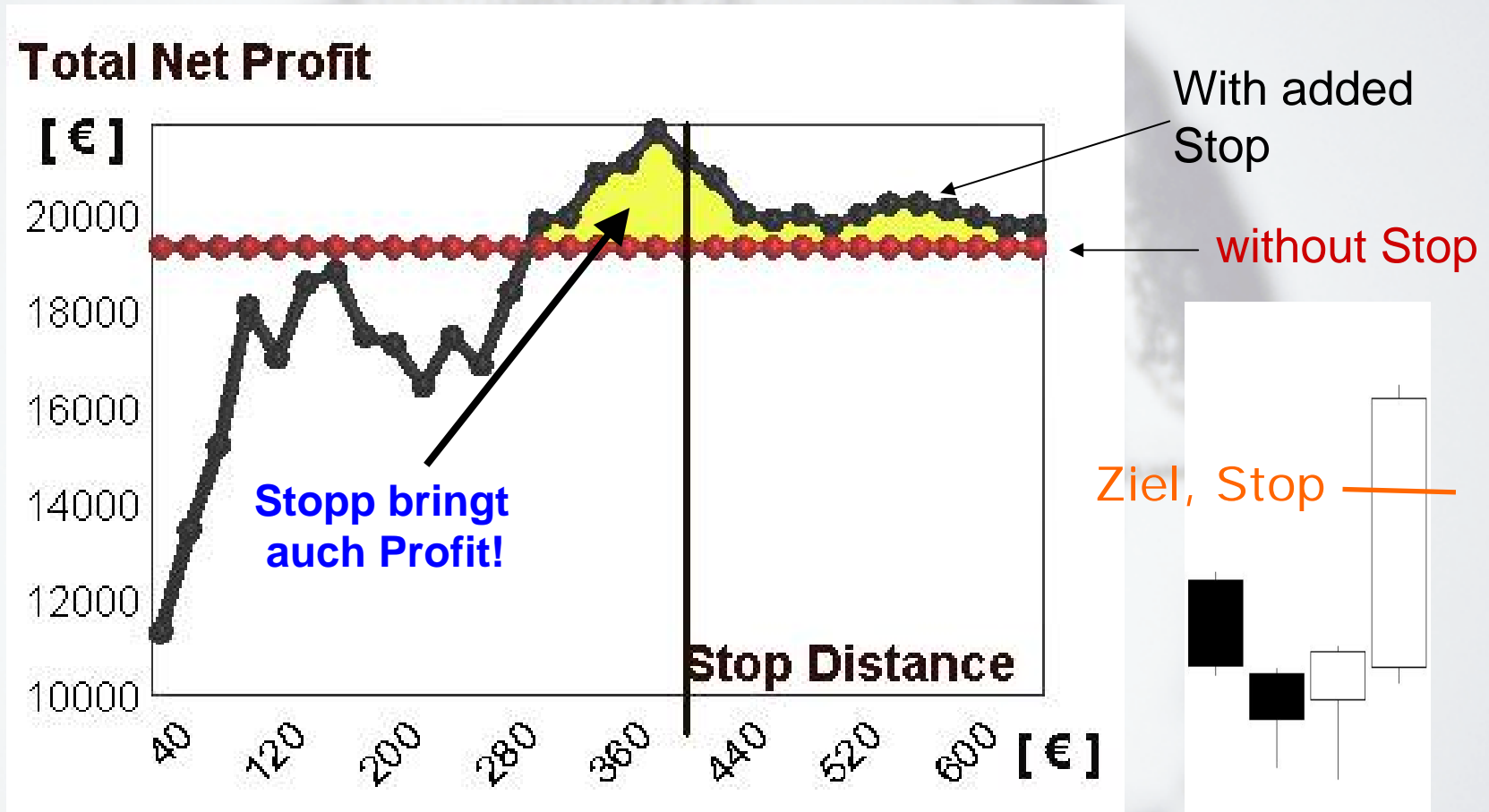
Entry: Toby Crabel ORB with daily filter; 2-3 % in market

Ausstiege für ein Daytrading System



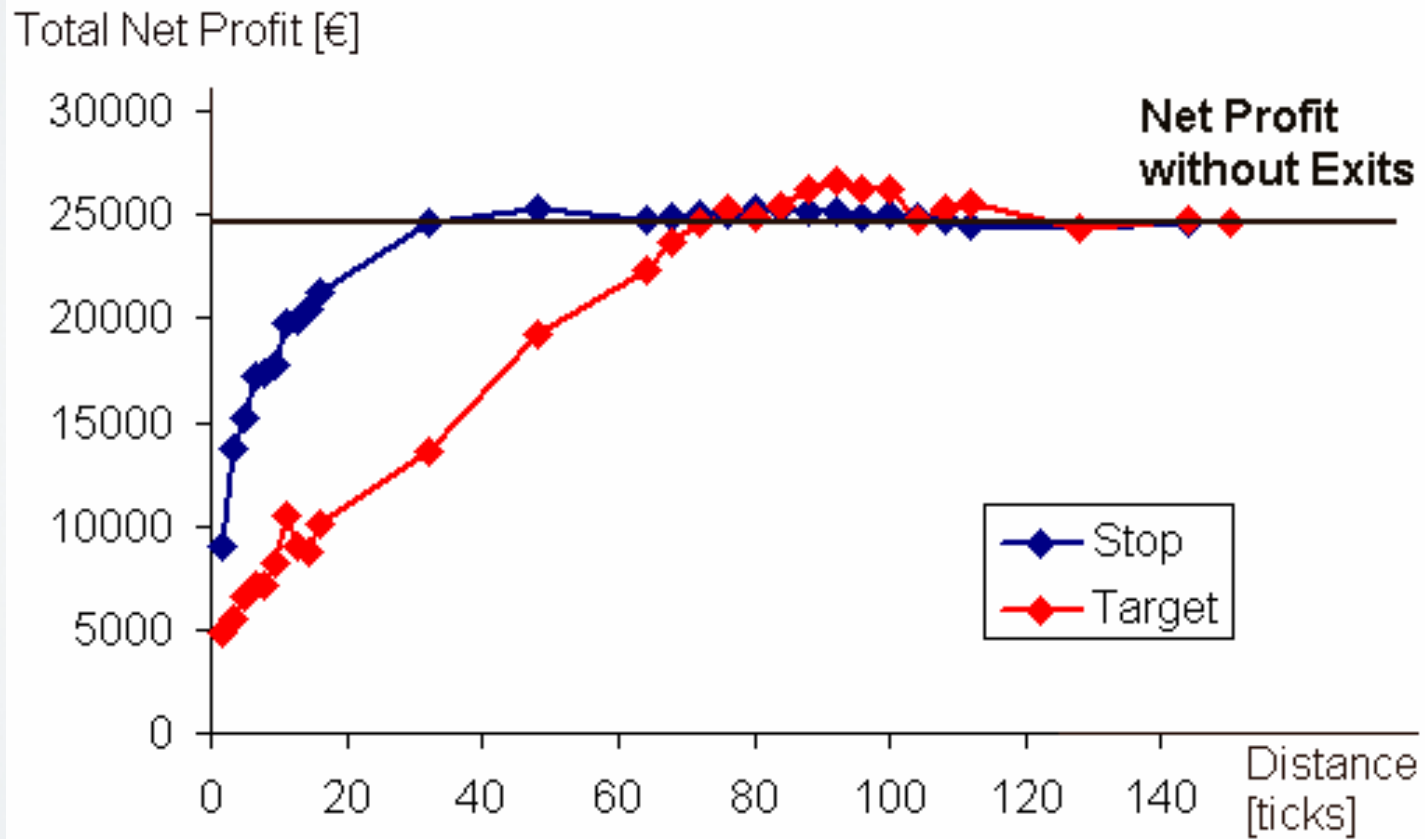
Exits on the DAX

Ausstiege für ein Daytrading System



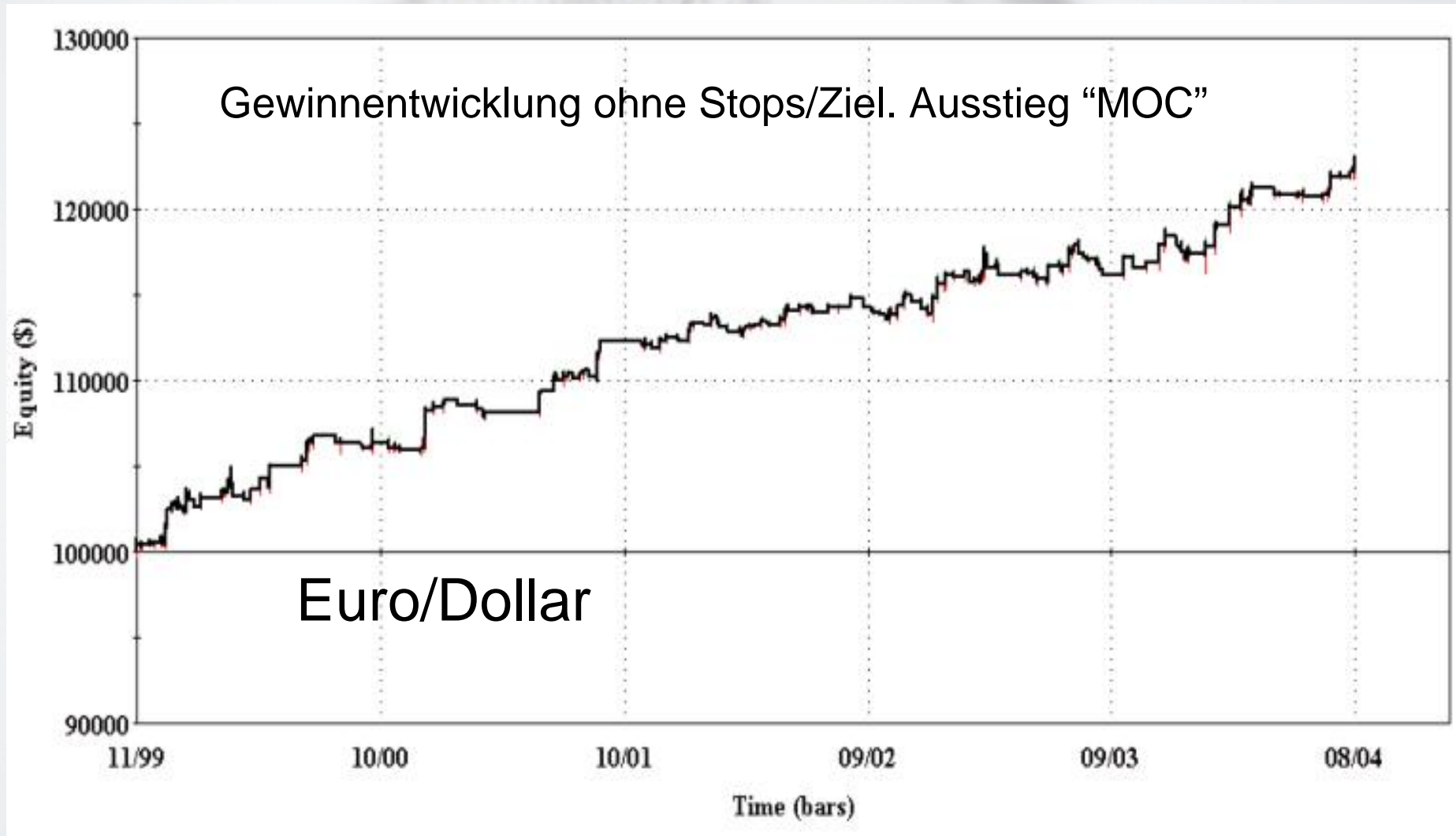
Stops for Bund

Ausstiege für ein Daytrading System



Exits on the Euro/Dollar

Ausstiege für ein Daytrading System



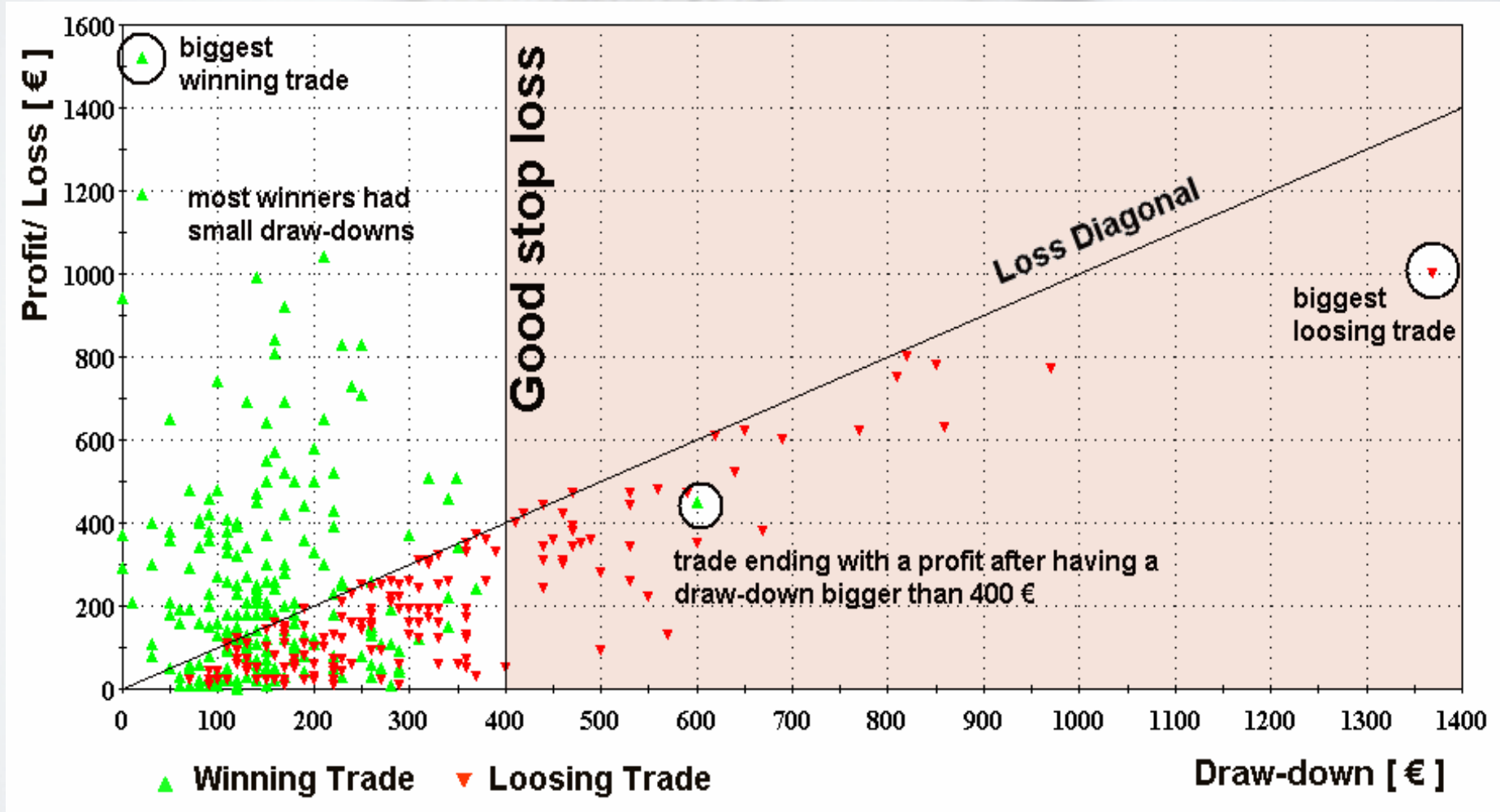
Ausstiege für ein Daytrading System

	Stop	Target
BUND	> 35 ticks	No
Euro/Dollar	> 40 ticks	100 ticks
DAX	> 20 points	60-120 points
ESTX50	> 25 points	> 30 points
S&P500	> 12 points	30-35 points
Nasdaq	> 10 points	25-30 points

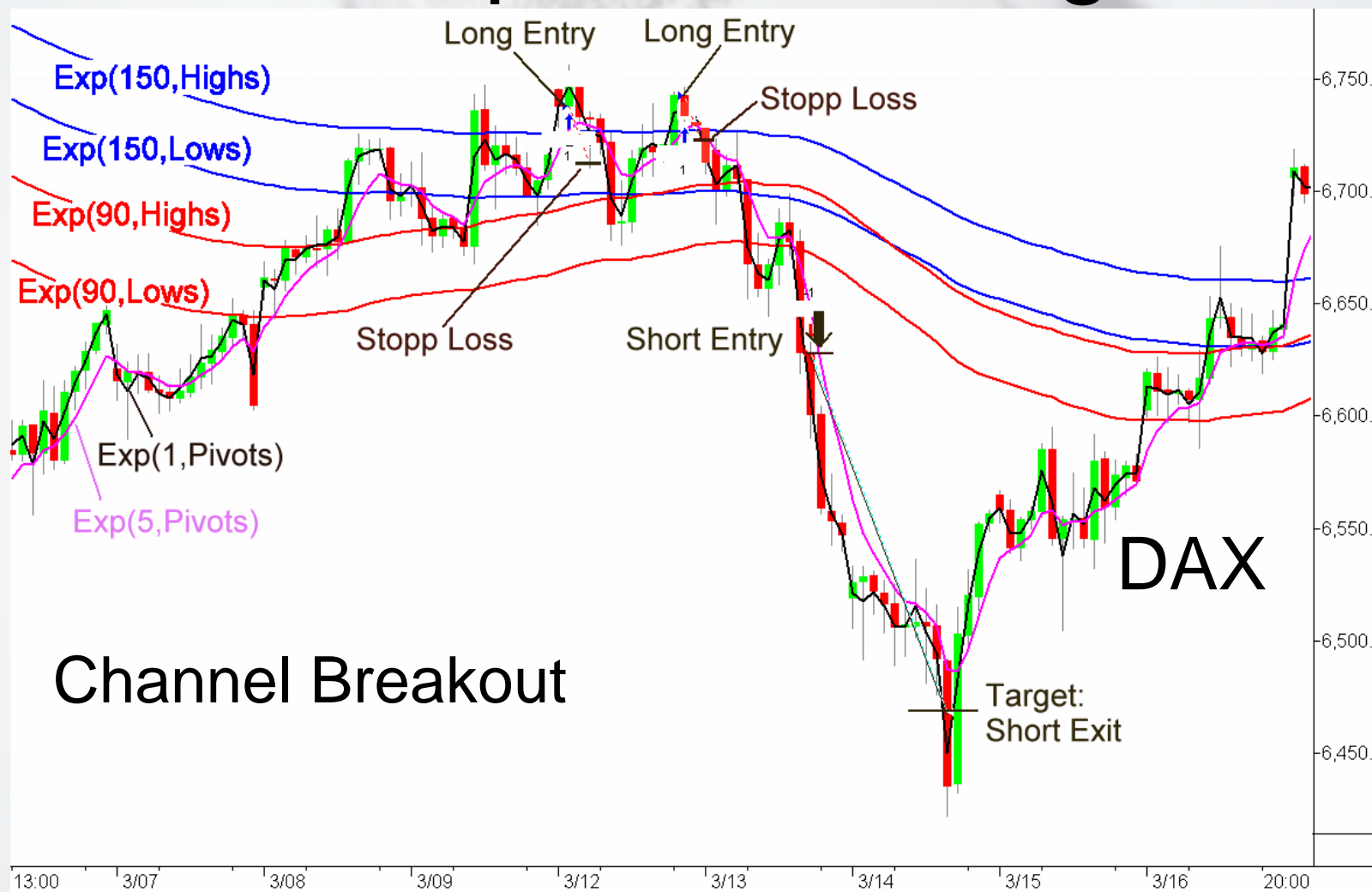
Suitable Stops and Profit Targets at present (2006!)

TRADERS' April 2006 and June 2006

Ausstiege für ein Daytrading System



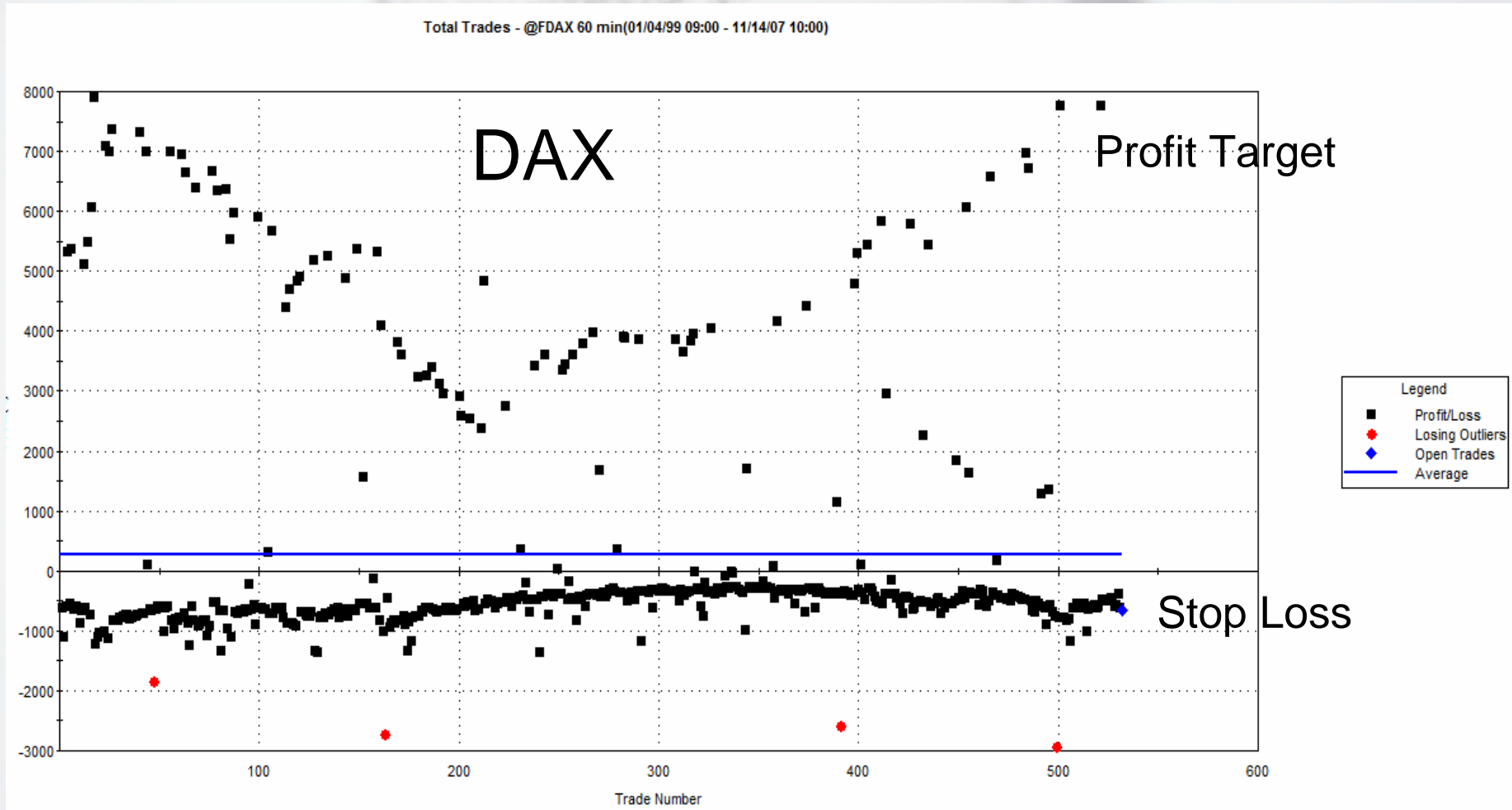
Adaptive Ausstiege



Adaptive Ausstiege



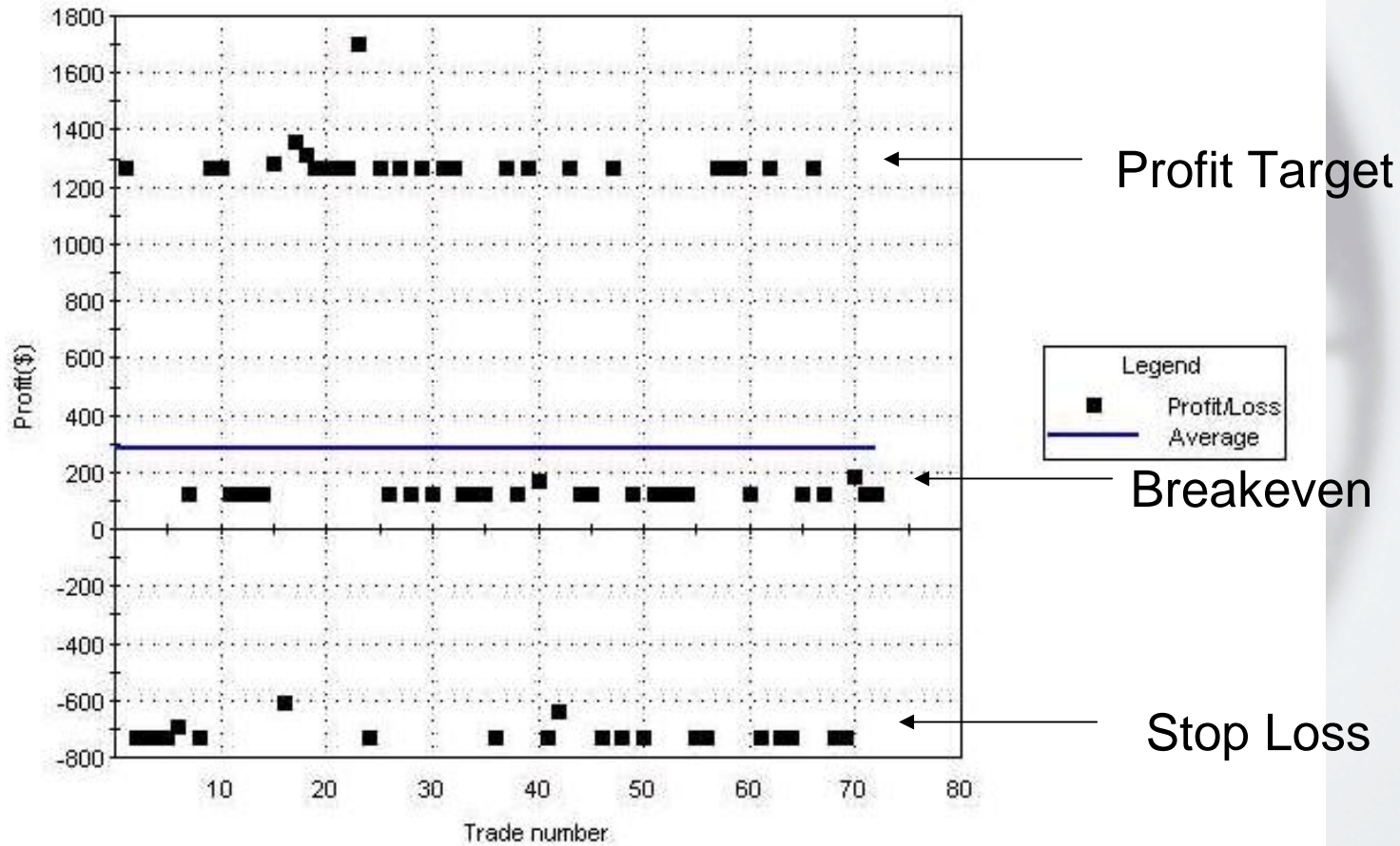
Adapt. Ausstiege -> Trade-Verteilung



Channel Breakout, 60 Min

Feste Ausstiege -> Trade-Verteilung

Channel Breakout, 120 Min; S&P400 (Midcap)



Zusammenfassung: Ausstiege

Money Management

Risiko Management

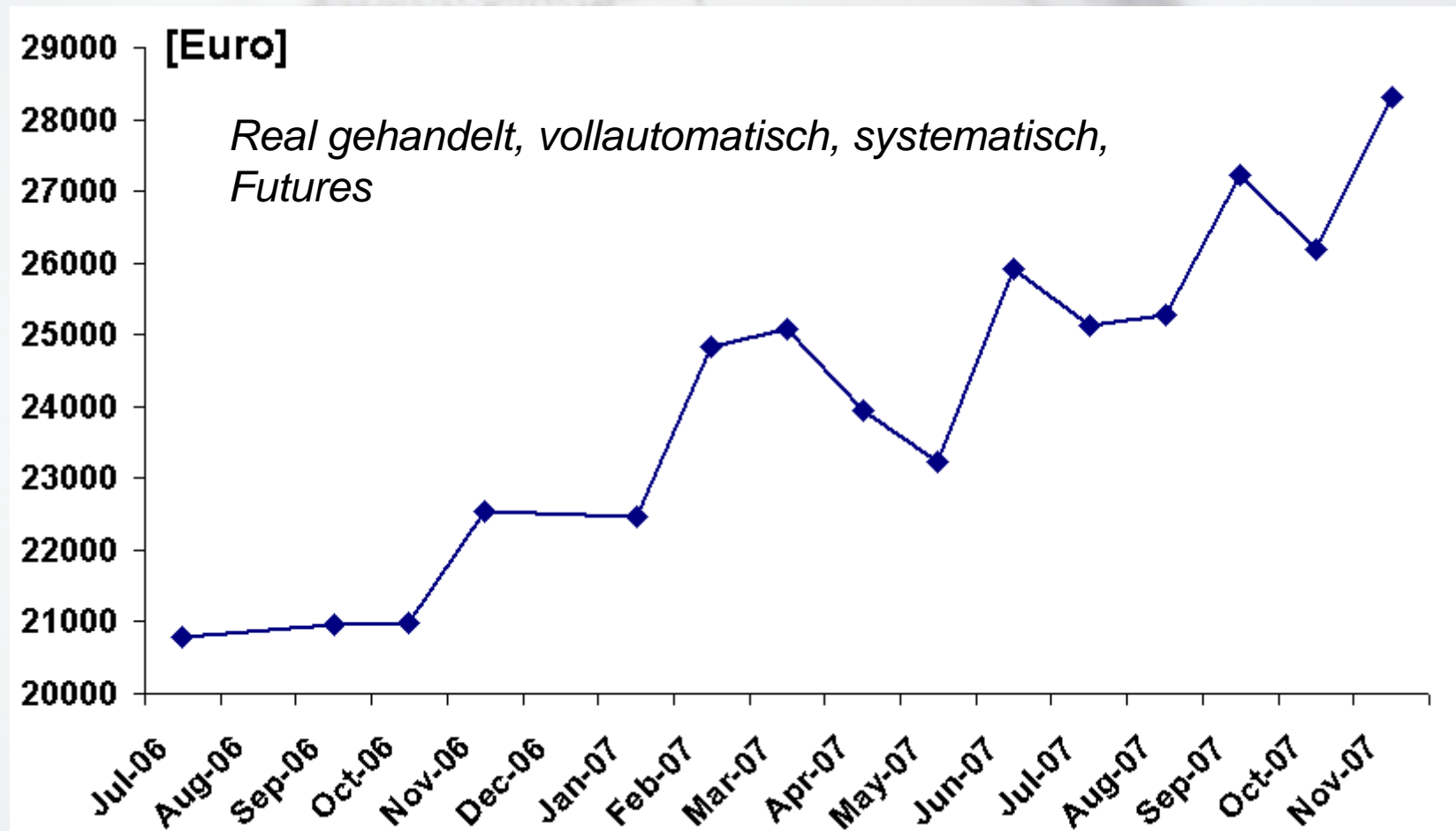
Gleichrichten von Trades

Rückgänge reduzieren

Ausstieg

Einstieg

... wie ich lernte, den Stopp zu lieben!



Märkte, Strategien und Stopps

Markt	Börse	Strategie	Chart	typ. Haltedauer	Stopp-Weite	Risiko pro Trade
US-T-Bond	CBO T	Trendfolge	90 Min	Stunden bis Wochen	1 - 1.5 Pkt.	1000-1500 \$
Bund	EUR EX	Trendfolge	Daily	Stunden bis Wochen	1-1.5 Pkt.	ca. 1200 Euro
Euro FX	CME	(False)- Breakout	5 Min	Intraday; MOC	30-40 ticks	ca. 500 \$
Light Crude Oil	NYM EX	Breakout	5 Min	Intraday; MOC	0.8 Punkte	ca. 800 \$
E-Mini S&P500	CME	Zeit	Daily	1-4 Tage	12 Punkte	600 \$
E-Mini Russell 2000	CME	Breakout/ Zeit	5 Min	1-2 Stunden	3 Punkte	ca. 300 \$
EuroStoxx50	EUR EX	Breakout/ Zeit	20 Min	Intraday; Exit 21:20	30 ticks	ca. 300 Euro

Mythos Handelssystem

„Meine“ Bücher:

Thomas Stridsman: Trading Systems that work, Mc Graw Hill

Jesse Livermore: How to Trade in Stocks , Mc Graw Hill

Neil T. Weintraub: Die Tricks der Floortrader, Finanzbuch Verlag

Toby Crabel: Day Trading with short term price patterns and opening range breakout.

Larry Williams: The definitive Guide to Futures Trading