

BIRGER
SCHÄFERMEIER

Die Kunst des **erfolgreichen** **Tradens**

**So werden Sie
zum Master Trader!**

FBV

© des Titels »Die Kunst des erfolgreichen Tradens« (ISBN Print 978-3-89879-672-9)
2012 by Finanzbuchverlag, Münchner Verlagsgruppe GmbH, München
Nähere Informationen unter: <http://www.finanzbuchverlag.de>

► Inhalt	
► Danksagung	10
► Vorwort	11

1: Was ein Trader wirklich will und wie er es erreicht **17**

Finden Sie heraus, was Sie wollen	17
Fragen Sie sich, welche Werte Sie in Ihrem Leben anstreben	20
Konditionieren Sie sich auf Erfolg!	23
Formulieren Sie Ihre Ziele richtig! Wichtige Regeln, die Sie beachten sollten, wenn Sie Ihre Ziele formulieren	25

2: Zwei Basics: Vor Ihrem Weg zum Master-Trader müssen Sie diese beiden Dinge akzeptieren! **29**

Übernehmen Sie 100 Prozent Verantwortung	29
Konzentrieren Sie sich auf die Dinge, die Sie wirklich kontrollieren können	32

3: Entwerfen Sie einen Plan, der funktioniert! **35**

Aufgaben eines Geschäfts- und Trading-Plans	35
So stellen Sie einen umfassenden Plan auf	40
Der Trading-Plan	48
Beispiel eines Business- und Trading-Plans	65
Mein Trading-Plan (auszugsweise)	70

4: Glaubenssysteme! 75

Wie funktioniert unser Gehirn?	75
Glaubenssätze bestimmen unser Verhalten.....	78
Es gibt keine Realität – nur eine interne Repräsentation der Welt	80
Wie Überzeugungen unser Handeln beeinflussen	82
Überzeugungen beim Traden	84
So finden Sie Glaubenssätze, die Sie unterstützen.....	88

5: Zustände und Stimmungen 93

Stimmungen bestimmen unser Verhalten. If you can handle your emotions, you can handle trading	93
Wie entstehen Stimmungen?	95
Disziplin	101
Schritte zur Disziplin.....	106
So entwickeln Sie einen Verhaltenskompass	109

6: Produktive Stimmungen für den Trading-Erfolg 117

Zustände und Daseinsformen von Tradern.....	117
Für jeden Trading-Schritt die optimale Stimmung.....	121
Exzellenz durch Stimmungskontrolle	129

7: Wie finde ich heraus, was eine gute Wette ist? 137

Marktanalyse und ihre Bedeutung	137
Das Chance-Risiko-Verhältnis	144
Kritik am Chance-Risiko-Verhältnis.....	147
Hit-Rate und Payoff-Ratio.....	148
Der Erwartungswert.....	154
Risk of Ruin	159

8: Anfänger legen großen Wert auf den richtigen Einstieg, dabei ist dieser am unwichtigsten **169**

Der Einstieg	169
Der zufällige Einstieg	170
So planen Sie Ihren Einstieg	173
Die Philosophie	173
Beurteilen Sie die psychologische Verfassung des Markts	178
Wann steigen wir ein? Klare objektive und spezifische Kriterien	180
Setzen Sie Ihre Regel konsequent um – auch in Verlustphasen	181
Wo steigen Sie ein, oder: So lauern Sie auf Ihren besten Einstieg	183
Poker-Strategie	184
Der Opportunity-Faktor	186
Diese Schritte müssen Sie gehen	187
Das sollten Sie bei jedem Einstieg beachten	188
Planen Sie mit jedem Einstieg bereits den Re-Entry	189
Seien Sie mit der ersten Position aggressiv, und laden Sie nach, sobald es für Sie läuft	190
Steigen Sie nicht zu häufig ein	191
Vermeiden Sie einen Einstieg vor wichtigen Wirtschaftsdaten	192
Gibt es einen klugen Entry, und wie sähe dieser aus?	192

9: Exit-Strategien sind das wahre Geheimnis der Master-Trader **195**

Das fundamentale Gesetz des Tradens – und warum so viele Exit-Strategien gegen dieses Gesetz verstoßen	195
Sind Sie endlich bereit dazu, um Ihre Gewinne zu pokern?	198
Die Truthahnfalle	200
Meine Exit-Regeln	205
So finden Sie Ihre perfekte Exit-Strategie	209

10: Auf der Suche nach der „Maximum Rate of Return“ 213

Das Kelly-Kriterium.....	213
Optimal-F.....	218
So berechnen Sie das Risk of Ruin eines Systems	221
Maximum Rate of Return	222

11: Monte-Carlo-Simulationen 231

Was unterscheidet eine Simulation vom Backtesting?.....	231
So simulieren Sie Ihr System	233
So entwickeln Sie eine Simulation auf Excel.....	237

12: Position-Sizing 245

Ein-Lot-Trader handeln suboptimal.....	245
Position-Sizing – der Turbo für Ihre Performance	249
So entwickeln Sie einen optimalen Money-Management-Algorithmus	255
Regeln des Position-Sizings	260
Verbillige nie.....	261
Erhöhe niemals dein Initial-Risiko	261
Übertrade nicht	261
Sei diszipliniert.....	262
So pyramidiert man.....	263
Psychologische Überlegungen beim Aufbau einer Pyramide	268
Beispiel einer Pyramide	270

13: Trading-Krisen erfolgreich überwinden 271

Regel 1: „Stay in Business“	271
Regel 2: „Frage nicht warum, sondern wie“	277
Wege aus der Krise	278
Sofortmaßnahmen	278
Generelle Maßnahmen	280
Externe Kontrolle.....	281
Interne Kontrolle	281

14: Trading bedeutet, strategisch zu denken 283

Trading-Taktiken	283
Trading-Taktik 1: Pokere um deine Gewinne.	285
Trading-Taktik 2: Reduziere dein Risiko nur im Verlust	286
Trading-Taktik 3: Versuche nicht, den Gewinn eines Trades, sondern die Summe aller Gewinn-Trades zu maximieren	287
Trading-Taktik 4: Verwende gemischte Strategien	289
Trading-Taktik 5: Pokere immer, wenn der Erwartungswert des Pokerspiels positiv ist	292
Trading-Taktik 6: Da wir als Trader immer ein Risiko eingehen müssen, sollten wir es eingehen, so früh es geht	297
Trading-Taktik 7: Sorgfältige Planung bringt Vorteile in unsicheren Situationen	298
Trading-Taktik 8: Wer im Vorteil ist, darf diesen nicht wieder hergeben	298
Trading-Taktik 9: Stelle deine Gewinne niemals gestaffelt glatt	299
Trading-Taktik 10: Leg Trading-Pausen ein	299