

Für "Programmier-Freaks" möchte ich hier an dieser Stelle ein preis- und volatilitätsbasiertes mechanisches Handelssystem-Portfolio auf den FDAX 15min-Bereich mit festen Signaltriggern in seiner ursprünglichen Grundstruktur vorstellen. Generiert werden 20-25 Trades pro Monat. Als Breakout- bzw. Rebreak-System konzipiert, ist es natürlich am besten für volatile Underlying geeignet. Im Gegenzug wäre ich natürlich an einem Source-Code für die Tradestation 2000i interessiert.

REGELWERK

FDAX-Handelssystem-Portfolio "SBreaker" (Timeframe 15min-Bar)

1. Stelle die Tagesextrema der letzten vier Handelstage fest (True-Range = gehandelter Höchst- und Tiefstkurs)
2. Stelle den Eröffnungskurs des heutigen Tages fest
3. Stelle den Schlusskurs des Vortages, den höchsten Perioden-Close des Vortages und den tiefsten Perioden-Close der Vortages fest
4. Ermittle die Average-True-Range (ATR) der letzten 3 Handelstage (berechnet auf 4 Dezimalstellen)

5. Long-Highbreak (1 - 3)

Eröffne eine **Long-Position**, sofern

- a) Eröffnung des heutigen Tages innerhalb der True-Range des Vortages erfolgt, per Buy-Stop-Order **0,5P** über dem Vortageshoch (**LHB1**).
- b) Regel 11. heute bereits zur Anwendung kam **oder gekommen wäre**, per Buy-Stop-Order am dafür gültigen Initial-Stop (IS2) (**LHB2**).
- c) True-Range des Vortages innerhalb der True-Range von vor zwei Tagen und Eröffnung des heutigen Tages über dem Vortageshoch aber unter dem Hoch von vor zwei Tagen erfolgt, per Buy-Stop-Order **0,5P** über dem Hoch von vor zwei Tagen (**LHB3**).

6. Long-Oops-Pattern (1 - 4)

Eröffne eine **Long-Position** per Buy-Stop-Order **0,5P** über dem Vortagestief, sofern

- a) Eröffnung des heutigen Tages unter dem Vortagestief, sowie mind. **5,0P** unter dem tiefsten Perioden-Close des Vortages erfolgt und der Schlusskurs des Vortages mind. **10,0P** oberhalb des Vortagestiefs lag (**LOP1**), oder
- b) Eröffnung des heutigen Tages unter dem Vortagestief, sowie mind. **10,0P** unter dem tiefsten Perioden-Close des Vortages erfolgt und der Schlusskurs des Vortages mind. **5,0P** oberhalb des Vortagestiefs lag (**LOP2**).
- c) Eröffnung des heutigen Tages unter dem Vortagestief, sowie mind. **50%** der ATR(**3**) unter dem Schlusskurs des Vortages erfolgt (**LOP3**).
- d) Eröffnung des heutigen Tages unter dem Vortagestief, sowie mind. **5,0P** unter dem tiefsten Perioden-Close des Vortages erfolgt und Vortagestief < Tagestief von vor zwei Tagen, Tagestief von vor zwei Tagen < Tagestief von vor 3 Tagen, sowie Tagestief von vor 3 Tagen < Tagestief von vor vier Tagen (**LOP4**).

7. Long-Low-Rebreak (1 - 4)

Eröffne eine **Long-Position**, sofern

- a) Regel 10. a) während des heutigen Handelstages bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre und bereits ein Perioden-Close von mind. **3,0P** unter dem Vortagestief vorlag, bei Perioden-Close von > **3,0P** über dem Vortagestief, per Buy-Limit-Order zum Open der nächsten Periode, max. **5,0P** über dem Vortagestief (**LLR1**), oder

- b) bereits ein Perioden-Close von mind. **3,0P** unter dem Vortagestief vorlag, bei Perioden-Close von **> 3,0P** über dem tiefsten Perioden-Close des Vortages, per Buy-Limit-Order zum Open der nächsten Periode, max. **5,0P** über dem tiefsten Perioden-Close des Vortages (**LLR2**).

Zusatzbedingungen für die Regeln nach Buchstabe a) und b): Sofern Handelsspanne der Signal-Bar **> oder = 30%** der ATR(**3**), eröffne die Long-Position per Buy-Limit-Order am Hoch der Signal-Bar abzüglich **50%** der Handelsspanne der Signal-Bar (bei Abrundung des berechneten 50%-Wertes auf volle Punkte). Lösche die Buy-Limit-Order, sofern diese nicht innerhalb der nächsten **beiden** Folgeperioden ausgeführt wurde.

- c) Regel 10. a) während des heutigen Handelstages bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre und bisher kein Perioden-Close von mind. **3,0P** unter dem Vortagestief vorlag, per Buy-Stop-Order **1,0P** über dem bis **11:30 Uhr** definierten Tageshoch des heutigen Handelstages vor Signalgenerierung, sofern dieses selbst mind. **5,0P** über dem Vortagestief liegt (**LLR3**).
- d) Regel 10. a) bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre und bereits ein Perioden-Close von mind. **3,0P** unter dem Vortagestief vorlag, per Buy-Stop-Order am definierten Tagestief des heutigen Handelstages vor Signalgenerierung, zuzüglich **50%** des Wertes der ATR(**3**) (bei Aufrundung des 50%-Wertes auf volle Punkte), sofern dieser Buy-Trigger selbst mind. **3,0P** über dem Vortagestief liegt (**LLR4**).

8. Long-Open-Range-Breakout (1 - 5)

Eröffne eine **Long-Position**, sofern

- a) Schlusskurs des Vortages **<** Schlusskurs von vor zwei Tagen per Buy-Stop-Order am Eröffnungskurs des heutigen Tages zuzüglich **35%** des Wertes der ATR(**3**) (bei Aufrundung auf volle Punkte) (**LORB1**).
- b) Schlusskurs des Vortages **> oder =** Schlusskurs von vor zwei Tagen per Buy-Stop-Order am Eröffnungskurs des heutigen Tages zuzüglich **50%** des Wertes der ATR(**3**) (bei Aufrundung auf volle Punkte) (**LORB2**).
- c) Schlusskurs des Vortages **> oder =** Schlusskurs von vor zwei Tagen und Eröffnungskurs des heutigen Tages **<** Schlusskurs des Vortages abzüglich **50%** des Wertes der ATR(**3**), per Buy-Stop-Order am Eröffnungskurs des heutigen Tages zuzüglich **35%** des Wertes der ATR(**3**) (bei Aufrundung auf volle Punkte) (**LORB3**).
- d) Regel 13. a) oder 13. b) bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre, per Buy-Stop-Order am definierten Tagestief des heutigen Handelstages vor Signalgenerierung, zuzüglich **50%** des Wertes der ATR(**3**) (bei Aufrundung des 50%-Wertes auf volle Punkte), sofern dieser Buy-Trigger selbst mind. **3,0P** über dem Vortagestief, oder mind. um den Wert **35%** von ATR(**3**) unter dem Vortagestief liegt (**LORB4**).
- e) das bis **11:30 Uhr** definierte Tageshoch des heutigen Handelstages bis **18:00 Uhr** überschritten wird und dieser Buy-Trigger selbst mind. **3,0P** über Daily-Pivot (Berechnung: H/L/C durch drei), oder mind. um den Wert **35%** von ATR(**3**) unter Daily-Pivot liegt, per Buy-Stop-Order **0,5P** über diesem Tageshoch (**LORB5**).

9. Long-Reentry (1 + 2)

Eröffne eine **Long-Position**, sofern zwischenzeitlich kein Gegensignal zu Handeln war und

- a) Regel 5. a) während des heutigen Handelstages bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre und die danach eröffnete Position nach Regel 17. oder 18. zu schließen war, bei Perioden-Close von mind. **1,0P** über dem nach Regel 17. berechneten Wert (PLdot) per Buy-Limit zum Open der nächsten Periode - max. **3,0P** über dem berechneten Wert nach Regel 17 (PLdot) - sofern dieser Wert selbst mind. **2,0P** über dem Vortageshoch liegt und der Schlusskurs der aktuellen Periode > Eröffnungskurs von vor zwei Perioden, sowie Schlusskurs von vor zwei Perioden < Eröffnungskurs von vor zwei Perioden (**LRE1**), oder
- b) Regel 5. a) während des heutigen Handelstages bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre und die danach eröffnete Position nach Regel 17. oder 18. zu schließen war, bei Perioden-Close von mind. **1,0P** über dem nach Regel 17. berechneten Wert

(PLdot) per Buy-Limit zum Open der nächsten Periode - max. **3,0P** über dem berechneten Wert nach Regel 17 (PLdot) - sofern dieser Wert selbst mind. **2,0P** über dem Vortageshoch liegt und der Schlusskurs der aktuellen Periode > Schlusskurs von vor zwei Perioden, sowie Schlusskurs von vor zwei Perioden > Eröffnungskurs von vor zwei Perioden (LRE2).

Zusatzbedingungen für die Regeln nach Buchstabe a) und b): Der aktuelle nach Regel 17. berechnete Periodenwert (PLdot) muss mind. **1,0P** größer sein, als der nach Regel 17. berechnete Periodenwert (PLdot) zum Zeitpunkt der Signalgenerierung nach Regel 5. Sofern Handelsspanne der Signal-Bar > oder = **30%** der ATR(**3**), eröffne die Long-Position per Buy-Limit-Order am Hoch der Signal-Bar abzüglich **50%** der Handelsspanne der Signal-Bar (bei Abrundung des berechneten 50%-Wertes auf volle Punkte). Lösche die Buy-Limit-Order, sofern diese nicht innerhalb der nächsten **beiden** Folgeperioden ausgeführt wurde.

10. Short-Lowbreak (1 - 3)

Eröffne eine **Short-Position**, sofern

- Eröffnung des heutigen Tages innerhalb der True-Range des Vortages erfolgt, per Sell-Stop-Order **0,5P** unter dem Vortagestief (**SLB1**).
- Regel 6. heute bereits zur Anwendung kam **oder gekommen wäre**, per Sell-Stop-Order am dafür gültigen Initial-Stop (IS2) (**SLB2**).
- True-Range des Vortages innerhalb der True-Range von vor zwei Tagen und Eröffnung des heutigen Tages unter dem Vortagestief aber über dem Tief von vor zwei Tagen erfolgt, per Sell-Stop-Order **0,5P** unter dem Tief von vor zwei Tagen (**SLB3**).

11. Short-Oops-Pattern (1 - 4)

Eröffne eine **Short-Position** per Sell-Stop-Order **0,5P** unter dem Vortageshoch, sofern

- Eröffnung des heutigen Tages über dem Vortageshoch, sowie mind. **5,0P** über dem höchsten Perioden-Close des Vortages erfolgt und der Schlusskurs des Vortages mind. **10,0P** unterhalb des Vortageshochs lag (**SOP1**), oder
- Eröffnung des heutigen Tages über dem Vortageshoch, sowie mind. **10,0P** über dem höchsten Perioden-Close des Vortages erfolgt und der Schlusskurs des Vortages mind. **5,0P** unterhalb des Vortageshochs lag (**SOP2**).
- Eröffnung des heutigen Tages über dem Vortageshoch, sowie mind. **50%** der ATR(**3**) über dem Schlusskurs des Vortages erfolgt (**SOP3**).
- Eröffnung des heutigen Tages über dem Vortageshoch, sowie mind. **5,0P** über dem höchsten Perioden-Close des Vortages erfolgt und Vortageshoch > Tageshoch von vor zwei Tagen, sowie Tageshoch von vor zwei Tagen > Tageshoch von vor 3 Tagen (**SOP4**).

12. Short-High-Rebreak (1 - 4)

Eröffne eine **Short-Position**, sofern

- Regel 5. a) während des heutigen Handelstages bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre und bereits ein Perioden-Close von mind. **3,0P** über dem Vortageshoch vorlag, bei Perioden-Close von > **3,0P** unter dem Vortageshoch, per Sell-Limit-Order zum Open der nächsten Periode, max. **5,0P** unter dem Vortageshoch (**SHR1**), oder
- bereits ein Perioden-Close von mind. **3,0P** über dem Vortageshoch vorlag, bei Perioden-Close von > **3,0P** unter dem höchsten Perioden-Close des Vortages, per Sell-Limit-Order zum Open der nächsten Periode, max. **5,0P** unter dem höchsten Perioden-Close des Vortages (**SHR2**).

Zusatzbedingungen für die Regeln nach Buchstabe a) und b): Sofern Handelsspanne der Signal-Bar > oder = **30%** der ATR(**3**), eröffne die Short-Position per Sell-Limit-Order am Tief der Signal-Bar zuzüglich **50%** der Handelsspanne der Signal-Bar (bei Abrundung des berechneten 50%-Wertes auf volle Punkte). Lösche die Sell-Limit-Order, sofern diese nicht innerhalb der nächsten **beiden** Folgeperioden ausgeführt wurde.

- Regel 5. a) während des heutigen Handelstages bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre und bisher kein Perioden-Close von mind. **3,0P** über dem Vortageshoch vorlag, per Sell-Stop-Order **1,0P** unter dem bis **11:30 Uhr** definierten Tagestief des

heutigen Handelstages vor Signalgenerierung, sofern dieses selbst mind. **5,0P** unter dem Vortageshoch liegt (**SHR3**).

- d) Regel 5. a) bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre und bereits ein Perioden-Close von mind. **3,0P** über dem Vortageshoch vorlag, per Sell-Stop-Order am definierten Tageshoch des heutigen Handelstages vor Signalgenerierung, abzüglich **50%** des Wertes der ATR(**3**) (bei Aufrundung des 50%-Wertes auf volle Punkte), sofern dieser Sell-Trigger selbst mind. **3,0P** unter dem Vortageshoch liegt (**SHR4**).

13. Short-Open-Range-Breakout (1 - 5)

Eröffne eine **Short-Position**, sofern

- a) Schlusskurs des Vortages > Schlusskurs von vor zwei Tagen per Sell-Stop-Order am Eröffnungskurs des heutigen Tages abzüglich **35%** des Wertes der ATR(**3**) (bei Abrundung auf volle Punkte) (**SORB1**).
- b) Schlusskurs des Vortages < oder = Schlusskurs von vor zwei Tagen per Sell-Stop-Order am Eröffnungskurs des heutigen Tages abzüglich **50%** des Wertes der ATR(**3**) (bei Abrundung auf volle Punkte) (**SORB2**).
- c) Schlusskurs des Vortages < oder = Schlusskurs von vor zwei Tagen und Eröffnungskurs des heutigen Tages > Schlusskurs des Vortages zuzüglich **50%** des Wertes der ATR(**3**), per Sell-Stop-Order am Eröffnungskurs des heutigen Tages abzüglich **35%** des Wertes der ATR(**3**) (bei Abrundung auf volle Punkte) (**SORB3**).
- d) Regel 8. a) oder 8. b) bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre, per Sell-Stop-Order am definierten Tageshoch des heutigen Handelstages vor Signalgenerierung, abzüglich **50%** des Wertes der ATR(**3**) (bei Aufrundung des 50%-Wertes auf volle Punkte), sofern dieser Sell-Trigger selbst mind. **3,0P** unter dem Vortageshoch, oder mind. um den Wert **35%** von ATR(**3**) über dem Vortageshoch liegt (**SORB4**).
- e) das bis **11:30 Uhr** definierte Tagestief des heutigen Handelstages bis **18:00 Uhr** unterschritten wird und dieser Sell-Trigger selbst mind. **3,0P** unter Daily-Pivot (Berechnung: H/L/C durch drei), oder mind. um den Wert **35%** von ATR(**3**) über Daily-Pivot liegt, per Sell-Stop-Order **0,5P** unter diesem Tagestief (**SORB5**).

14. Short-Reentry (1 + 2)

Eröffne eine **Short-Position**, sofern zwischenzeitlich kein Gegensignal zu Handeln war und

- a) Regel 10. a) während des heutigen Handelstages bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre und die danach eröffnete Position nach Regel 17. oder 18. zu schließen war, bei Perioden-Close von mind. **1,0P** unter dem nach Regel 17. berechneten Wert (PLdot) per Sell-Limit-Order zum Open der nächsten Periode - max. **3,0P** unter dem berechneten Wert nach Regel 17 (PLdot) - sofern dieser Wert selbst mind. **2,0P** unter dem Vortagestief liegt und der Schlusskurs der aktuellen Periode < Eröffnungskurs von vor zwei Perioden, sowie Schlusskurs von vor zwei Perioden > Eröffnungskurs von vor zwei Perioden (**SRE1**), oder
- b) Regel 10. a) während des heutigen Handelstages bereits zur Anwendung kam oder gekommen wäre und die danach eröffnete Position nach Regel 17. oder 18. zu schließen war, bei Perioden-Close von mind. **1,0P** unter dem nach Regel 17. berechneten Wert (PLdot) per Sell-Limit-Order zum Open der nächsten Periode - max. **3,0P** unter dem berechneten Wert nach Regel 17 (PLdot) - sofern dieser Wert selbst mind. **2,0P** unter dem Vortagestief liegt und der Schlusskurs der aktuellen Periode < Schlusskurs von vor zwei Perioden, sowie Schlusskurs von vor zwei Perioden < Eröffnungskurs von vor zwei Perioden (**SRE2**).

Zusatzbedingungen für die Regeln nach Buchstabe a) und b): Der aktuelle nach Regel 17. berechnete Periodenwert (PLdot) muss mind. **1,0P** kleiner sein, als der nach Regel 17. berechnete Periodenwert (PLdot) zum Zeitpunkt der Signalgenerierung nach Regel 10. Sofern Handelsspanne der Signal-Bar > oder = **30%** der ATR(**3**), eröffne die Short-Position per Sell-Limit-Order am Tief der Signal-Bar zuzüglich **50%** der Handelsspanne der Signal-Bar (bei Abrundung des berechneten 50%-Wertes auf volle Punkte). Lösche die Sell-Limit-Order, sofern diese nicht innerhalb der nächsten **beiden** Folgeperioden ausgeführt wurde.

15. Setze für Positionen, welche nach den Regeln 5. a), 5. c), 7. a) – c), 8. a) – c), 10. a), 10. c), 12. a) – c) und 13. a) – c) eröffnet wurden, einen **Initial-Stop (IS1)** (Berechnung: **35%** der ATR(3) bei Aufrundung auf 0,5P, max. **25,0P**). Berechne diesen zum Handelsende für den nächsten Handelstag jeweils neu.

Setze für Positionen, welche nach den Regeln 5. b), 6., 8. e), 10. b), 11. und 13. e) eröffnet wurden einen **Initial-Stop (IS2)** (Berechnung: **20%** der ATR(3) bei Aufrundung auf 0,5P, max. **15,0P**).

Setze für Positionen, welche nach den Regeln 9. und 14. eröffnet wurden einen **Initial-Stop (IS3)** (Berechnung: **25%** der ATR(3) bei Aufrundung auf 0,5P, max. **15,0P**) max. **5,0P** unter dem Vortageshoch (Long-Modus) bzw. **5,0P** über dem Vortagestief (Short-Modus).

Setze für Positionen, welche nach den Regeln 7. d), 8. d), 12. d) und 13. d) eröffnet wurden einen **Initial-Stop (IS4)** (Berechnung: **35%** der ATR(3) bei Aufrundung auf 0,5P, max. **20,0P**).

16. Aktiviere für Positionen, welche nach den Regeln 5., 6., 10. und 11. eröffnet wurden, einen **Breakeven-Stop (BES1)** ab einer Breakeven-Schwelle (Berechnung Breakeven-Schwelle: **30%** der ATR(3) bei Aufrundung auf volle Punkte), berechnet vom höchsten Periodenhoch (Long-Modus) bzw. tiefsten Periodentief (Short-Modus) des Handelstages nach Signalgenerierung.

Aktiviere für Positionen, welche nach den Regeln 7. a) – c), 9., 12. a) – c) oder 14. eröffnet wurden, oder sofern Systemstatus overnight "Long" bzw. "Short" für den nächsten Handelstag einen **Breakeven-Stop (BES2)**, ab einer Breakeven-Schwelle (Berechnung Breakeven-Schwelle: **25%** der ATR(3) bei Aufrundung auf volle Punkte), berechnet vom höchsten Periodenhoch (Long-Modus) bzw. tiefsten Periodentief (Short-Modus) nach Signalgenerierung.

Aktiviere für Positionen, welche nach den Regeln 7. d), 8., 12. d) und 13. eröffnet wurden, einen **Breakeven-Stop (BES3)**, ab einer Breakeven-Schwelle (Berechnung Breakeven-Schwelle: **25%** der ATR(3) bei Aufrundung auf volle Punkte), berechnet vom höchsten Periodenhoch (Long-Modus) bzw. tiefsten Periodentief (Short-Modus) nach Signalgenerierung.

17. Aktiviere bei Erreichen der Breakeven-Stop-Schwelle nach Regel 16. (BES1 – BES3), außer für Positionen, welche nach den Regeln 5., 7. c), 12. c) und 10. eröffnet wurden, zusätzlich einen **Trailing-Stop (TS1)** auf Periodenschlussbasis (Berechnung Trailing-Stop: **Einfacher** gleitender Durchschnitt der letzten **17** Perioden berechnet auf Division High/Low/Close der vorhergehenden Perioden durch drei), sobald dieser Wert selbst mind. **3,0P** unter (Long-Modus) bzw. mind. **3,0P** über (Short-Modus) dem letzten Perioden-Close liegt. Der ermittelte Wert ist auf volle Punkte abzurunden (Long-Modus) bzw. auf volle Punkte aufzurunden (Short-Modus). Hierbei handelt es sich um einen SMA17 berechnet auf den 15min-Pivot (Pldot). Der Trailing-Stop gilt als ausgelöst, sobald ein Perioden-Close mind. **3,0P** unter (Long-Modus) bzw. mind. **3,0P** über (Short-Modus) dem berechneten Wert stattfindet. Die Position ist sodann zum Perioden-Open der nächsten Periode per Buy- bzw. Sell-Limit-Order glattzustellen.

18. Aktiviere bei Erreichen der Breakeven-Stop-Schwelle nach Regel 16. (BES1) zusätzlich einen **Trailing-Stop (TS2)** berechnet vom höchsten Periodenhoch (Long-Modus) bzw. tiefsten Periodentief (Short-Modus) des Handelstages nach Signalgenerierung (Berechnung: **35%** der ATR(3) bei Aufrundung auf volle Punkte). Berechne diesen zum Handelsende für den nächsten Handelstag jeweils neu.

Aktiviere bei Erreichen der Breakeven-Stop-Schwelle nach Regel 16. (BES2), oder sofern die Position nach den Regeln 7. d), 8. d), 12. d) und 13. d) eingegangen wurde und Systemstatus overnight „Long“ bzw. „Short“, zusätzlich einen **Trailing-Stop (TS3)** berechnet vom höchsten

Periodenhoch (Long-Modus) bzw. tiefsten Periodentief (Short-Modus) des Handelstages nach Signalgenerierung (Berechnung: **20%** der ATR(**3**) bei Aufrundung auf volle Punkte). Berechne diesen zum Handelsende für den nächsten Handelstag jeweils neu.

Aktiviere bei Erreichen der Breakeven-Stop-Schwelle nach Regel 16. (BES3), **ausgeschlossen für Positionen welche nach den Regeln 8. e) und 13. e) eingegangen wurden**, zusätzlich einen **Trailing-Stop (TS4)** berechnet vom höchsten Periodenhoch (Long-Modus) bzw. tiefsten Periodentief (Short-Modus) des Handelstages nach Signalgenerierung (Berechnung: **30%** der ATR(**3**) bei Aufrundung auf volle Punkte). Berechne diesen zum Handelsende für den nächsten Handelstag jeweils neu.

Aktiviere bei Erreichen der Breakeven-Stop-Schwelle nach Regel 16. (BES3), **sofern die Position nach den Regeln 8. e) oder 13. e) eingegangen wurde**, zusätzlich einen **Trailing-Stop (TS5)** berechnet vom höchsten Periodenhoch (Long-Modus) bzw. tiefsten Periodentief (Short-Modus) des Handelstages nach Signalgenerierung (Berechnung: **25%** der ATR(**3**) bei Aufrundung auf volle Punkte).

19. Überprüfe die Stop-Varianten und benutze immer den nächstliegenden Stop.

20. Stelle die Position am Gegensignal (**GS**) glatt.

21. Stelle die Position zum nächsten Perioden-Open per Buy- bzw. Sell-Limit-Order glatt, sofern sich die Position im Verlust befindet und der Perioden-Close 19:45 Uhr mind. **1,0P** unter (Long-Modus) bzw. mind. **1,0P** über (Short-Modus) dem nach Regel 17. berechneten Wert (Pldot) erfolgte (**EOD1**).

22. Stelle die Position zum nächsten Perioden-Open per Buy- bzw. Sell-Limit-Order glatt, sofern diese nach Regeln **8. a), 8. c), 13. a) und 13. c)** eröffnet wurde und der Perioden-Close 19:45 Uhr nicht mind. **1,0P** über (Long-Modus) bzw. nicht mind. **1,0P** unter (Short-Modus) dem Vortageshoch erfolgte (**EOD2**).

Stelle die Position zum nächsten Perioden-Open per Buy- bzw. Sell-Limit-Order glatt, sofern diese nach Regel **7. a) – c) und 12. a) – c)** eröffnet wurde und der Perioden-Close 19:45 Uhr nicht mind. **1,0P** über (Long-Modus) bzw. nicht mind. **1,0P** unter (Short-Modus) dem Pldot (Berechnung PLdot: Einfacher gleitender Durchschnitt der letzten drei Handelstage berechnet auf Division High/Low/Close durch drei) erfolgte (**EOD2**).

23. Stelle die Position um 19:45 zum nächsten Perioden-Open per Buy- bzw. Sell-Limit-Order glatt, sofern diese nach Regel **5.b), 6., 7. d), 8. b), 8. d), 8. e), 9., 10.b), 11., 12. d), 13. b), 13. d), 13. e)** oder 14. eröffnet wurde (**EOD3**).

24. Die Regeln 1-14 können an einem Handelstag jeweils nur einmal Anwendung finden.

25. Stelle die Positionen, welche nach den Regeln **6. c) oder 11. c)** eröffnet wurden, am Schlusskurs des Vortages, max. am **30,0P**-Gewinnziel glatt (**PT1**).

Stelle die Positionen, welche nach den Regeln **6. a), 6. b), 6. d), 11. a), 11. b)** oder 11. d) eröffnet wurden, am **30,0P**-Gewinnziel glatt (**PT2**).

Stelle die Positionen, welche nach den Regeln **8. e) und 13. e)** eröffnet wurden, am Gewinnziel glatt (Berechnung: **30%** der ATR(**3**) bei Abrundung auf volle Punkte) (**PT3**).

Stelle die Positionen, welche nach den Regeln 7. a) – d), 8. a) – d), 9. a) + b), 12. a) – d), 13. a) – d), oder 14. a) + b) eröffnet wurden, am Gewinnziel glatt (Berechnung: **125%** der ATR(**3**) bei Abrundung auf volle 2,5 Punkte) **(PT4)**.

Stelle die Positionen, welche nach den Regeln 5. a) – c) und 10.a) – c) eröffnet wurden, am Gewinnziel glatt (Berechnung: **200%** der ATR(**3**) bei Abrundung auf volle 2,5 Punkte) **(PT5)**.

26. Überprüfe den Systemstatus. Wenn dieser nicht "Flat", dann ignoriere folgende Signale in Handelsrichtung.

27. Anforderungen an eine Signal-Bar (Perioden-Close-Regel):

Long-Modus:

Handelsspanne mind. **5,0P**

Schlusskurs > Eröffnungskurs

Schlusskurs im **oberen Drittel** der Handelsspanne

Eröffnungskurs im **unteren Drittel** der Handelsspanne

Short-Modus:

Handelsspanne mind. **5,0P**

Schlusskurs < Eröffnungskurs

Schlusskurs im **unteren Drittel** der Handelsspanne

Eröffnungskurs im **oberen Drittel** der Handelsspanne

28. Die Handelszeit, während derer Signale gehandelt werden können, läuft von **09:00 Uhr** bis **19:30 Uhr**.

Anmerkung:

Da es sich um ein Breakout-System handelt, welches zum Teil mit Stop-Orders arbeitet, wird in den Trackrecord eine "großzügige" Roundturn-Slippage i.H.v. 2,5P eingearbeitet. Handelsgebühren sollen darin allerdings enthalten sein. Ich denke, dass dies der Realität Rechnung trägt.