

Zinsdifferenz

1. Beschreibung der Strategie:

- 1.1. Betrachtung der Zinsdifferenz z.B. zwischen 2-jährigen Anleihen der Eurozone und der USA.
- 1.2. Mittelwert der Zinsdifferenz über die letzten 30 Handelstage als Referenz
 - 1.2.1. Aktuelle Zinsdifferenz > Mittelwert --> Long EURUSD
 - 1.2.2. Aktuelle Zinsdifferenz < Mittelwert --> Short EURUSD
 - 1.2.3. **Details:**
 - 1.2.3.1. Immer investiert (kein Stopp Loss, kein Take Profit)
 - 1.2.3.2. Signal basiert ausschließlich auf der Zinsdifferenz, Wechselkurs EURUSD wird nicht berücksichtigt
 - 1.2.3.3. Zinsdaten werden aus MetaTrader 5 maschinell ermittelt
 - 1.2.4. **Parameter**
 - 1.2.4.1. Zeitraum für Mittelwert: Editierbar (Standard: 30 Handelstage)
 - 1.2.4.2. Indikator Multitimeframe-fähig
- 1.3. Die Zinsdifferenz soll auch für andere 2-jährigen Anleihezinsen anwendbar sein, wie z.B. JP02Y – EU02Y, oder GB02Y-US02Y.
- 1.4. Formel für die Zinsdifferenz:

2-jährige Anleihezins A ./ 2-jährige Anleihezins = Zinssatz

1.5. Screenshot Tradingview:



2. Globale Settings:

Trade Richtung:

- 2.1. Long
- 2.2. Short

3. Money Management:

3.1. Dynamische Lotgröße anhand Balance

3.1.1. **False**

3.1.2. **True**

Wenn True, dann Eingabe eines Betrags notwendig.

Ich möchte die Positionsgröße anhand eines definierten Wertes wählen, der ausgehend vom erreichten Betrag die nächstgrößere Positionsgröße bestimmt.

Berechnungsformel Lotgröße:

$\text{Kontostand} / \text{Wert} * \text{Mindestlotgröße}$

Beispiele:

1.) Kontostand 10.000 EUR;
eingegebener Wert = 2.000 EUR,
Mindestlotgröße für den Basiswert = 0,2

--> Positionsgröße ist also **1,0**

2.) Kontostand 10.000 EUR,
eingegebener Wert = 5.000 EUR,
Mindestlotgröße für den Basiswert = 0,2

--> Positionsgröße ist also = **0,4**

3.) Kontostand 10.000 EUR,
eingegebener Wert = 6.000 EUR,
Mindestlotgröße für den Basiswert = 0,2

--> Positionsgröße ist also = **0,6**

4.) Kontostand 10.000 EUR,

angegebener Wert = 7.500 EUR,
Mindestlotgröße für den Basiswert = 0,2

--> Positionsgröße ist also = **0,6**

5.) Kontostand 20.000 EUR,

angegebener Wert = 1.000 EUR,
Mindestlotgröße für den Basiswert = 0,2

--> Positionsgröße ist also = **4,0**

Unabhängig vom Kontostand sollte immer die Mindestlotgröße eröffnet werden.

3.1.3. **Manual Lot Size (manuelle Eingabe der Lotgröße)**

3.1.3.1. **False**

3.1.3.2. **True**

Wenn True, dann manuelle Eingabemöglichkeit ermöglichen.

3.1.4. **Initial risk per Trade**

3.1.4.1. **False**

3.1.4.2. **True**

Beispiel 1% vom Kontostand.

Kontostand = 10.000 EUR * 1% = 100€ maximaler Risk per Trade

3.2. **Take-Profit**

3.2.1. **Take-Profit basierend auf einem % Gewinn des Underlyings**

Definition: Der Take-Profit wird aktiviert, wenn der Preis des gehandelten Underlyings (z. B. ein Index, eine Aktie oder ein Währungspaar) um einen bestimmten Prozentsatz steigt.

Parameter:

- Profit_Percentage_Asset: Prozentsatz des Gewinns am Underlying (z. B. 1%, 2%, 5%).
- Entry_Price: Der Einstiegspreis der offenen Position.

- Berechnung des Zielpreises:

$$\text{Zielpreis} = \text{Entry_Price} \times (1 + \text{Profit_Percentage_Asset}/100)$$

- **Trigger:** Sobald der aktuelle Preis den Zielpreis erreicht oder überschreitet, wird die Position automatisch geschlossen.

3.3. Take-Profit basierend auf einem % Gewinn der Equity

Definition: Der Take-Profit wird aktiviert, wenn die Gesamt-Eigenkapitalrendite des Kontos um einen bestimmten Prozentsatz steigt (z. B. 30%).

Parameter:

- Profit_Percentage_Equity: Zielwachstum der Equity in Prozent (z. B. 30%).

-Initial_Equity: Startwert des Eigenkapitals (bei Handelsbeginn oder initialer Berechnung).

-Berechnung des Zielwertes

$$\text{Ziel_Equity} = \text{Initial_Equity} \times (1 + \text{Profit_Percentage_Equity}/100)$$

Trigger:

Sobald die aktuelle Equity den Zielwert erreicht oder überschreitet, werden **alle offenen Positionen geschlossen**, um den Gewinn zu sichern.

3.4. Stopp-Loss (Dropdown-Funktion):

3.5. **False**

3.6. **True**

3.6.1. Prozentualer Stopp-Loss:

Ermittlung Stopp-Loss anhand Initial Risk per Trade. Beispiel:

Kontostand = 10.000€, 1% Risiko pro Trade = 100€. Der Stopp-Loss wird so gesetzt, dass der Verlust maximal 100€ beträgt.

3.6.2. Technischer Stopp-Loss:

Automatische Platzierung und Verwaltung eines Stopp-Loss-Levels basierend auf Schlüsselmarken wie Unterstützungs-, Widerstands- oder Pivot-Punkten.

Key-Level-Erkennung:

- **Long-Position:** Der Stopp-Loss wird knapp unterhalb des erkannten Unterstützungslevels platziert.
- **Short-Position:** Der Stopp-Loss wird knapp oberhalb des erkannten Widerstandslevels platziert.

Dynamische Anpassung:

- Der Stopp-Loss wird automatisch verschoben, wenn sich neue Schlüsselmarken bilden.
- Bei starker Kursbewegung in Richtung der Position (Trendfortsetzung) sollte der Stopp-Loss optional auf neue Unterstützungs-/Widerstandsmarken angepasst werden (Trailing).

Identifikation von Schlüsselmarken:

- **Unterstützungs- und Widerstandsniveaus:**
 - Analyse von historischen Höchst- und Tiefstpunkten im Chart.
 - Verwendung eines definierten Zeitrahmens (z. B. H1, H4 oder Daily).

- **Pivot-Punkte:**

- ♣ Berechnung nach der klassischen Pivot-Punkt-Formel:

$$Pivot = \frac{Hoch + Tief + Schlusskurs}{3}$$

- ♣ Unterstützung 1 (S1), Widerstand 1 (R1) und weitere Levels entsprechend ableiten.

- **Platzierung des Stopp-Loss:**

- **Long-Position:**

- Stopp-Loss = Unterstützungslevel - X Pips (X = benutzerdefinierter Abstand, z. B. 5 Pips).

- **Short-Position:**

- Stopp-Loss = Widerstandslevel + X Pips (X = benutzerdefinierter Abstand, z. B. 5 Pips).

- **Einstellbare Parameter:**

- Zeitrahmen für die Analyse (z. B. M15, H1, H4, Daily).
- Abstand (in Pips) zwischen Schlüsselmarke und Stopp-Loss.

- **Trailing-Stopp-Option (optional):**

- Trailing anhand des Supertrend-Indikators:

- **False**

- **True**

- ♣ Long-Signal, wenn Supertrend auf grün wechselt

- ♣ Short-Signal, wenn Supertrend auf Rot wechselt

- ♣ Multitimeframefähig (Indicator Timeframe)

- ♣ ATR Period (editierbar)

- ♣ Quelle (open, close, high, etc.) editierbar

- ♣ ATR Multiplier (editierbar)

- Screenshot Indikatoreneinstellung aus Tradingview

3.6.3. ATR-basierter Stopp-Loss:

3.6.3.1. **False**

3.6.3.2. **True**

Der Stopp-Loss wird auf Basis der **Average True Range (ATR)** gesetzt, die die durchschnittliche Marktvolatilität misst.

4. Pyramidisierung:

Nach der initialen Eröffnung soll der Expert Advisor auf dem ausgewählten Timeframe und gewählten Traderichtung weitere Positionen in einem definierten prozentualen oder fixen Wert eröffnen.

4.1. **False** --> keine Pyramidisierung

4.2. **True**

- 4.2.1. Editierbar: Maximale Anzahl Positionen = 1000
- 4.2.2. Eröffnung weiterer Position anhand gewählten Timeframe (z.B. M1 --> Eröffnung neue Position im Minutentakt)
- 4.2.3. Tradeabstand (nur eine Auswahlmöglichkeit zulassen)
 - 4.2.3.1. Prozentual Abstand vom Underlying
(z.B. DAX = 15.000 Punkte; bei 0,0500% Abstand zur initialen Position weitere Eröffnung einer Position = 7,5 Punkte im DAX neue Eröffnung).

Somit weitere Eröffnung bei 15.007,5; 15.015; 15.022,5,
- 4.2.3.2. Fixer Punkteabstand (z.B. 10 Punkte im DAX)

5. **Indikatoren:**

- 5.1. **Moving Average (EMA / SMA / WMA)**
 - 5.1.1. **False**
 - 5.1.2. **True**
 - 5.1.2.1. Länge (editierbar)
 - 5.1.2.2. Quelle (open, Close, high, etc.) --> editierbar
 - 5.1.2.3. Moving Average Typ (SMA, EMA, SMMA, WMA, VWMA) --> editierbar
 - 5.1.2.4. Multiframefähig (editierbar)

5.1.2.5. Screenshots aus Tradingview

EMA ✕

Eingaben **Stil** **Sichtbarkeit**

Länge

Quelle

Offset

MOVING AVERAGE

Typ

Länge

BB StdDev

CALCULATION

Zeitraumen

Warten Sie auf die Zeitr Rahmenschließung

Standar...

EMA ✕

Eingaben **Stil** **Sichtbarkeit**

Länge

Quelle

Offset

MOVING AVERAGE

Typ

Länge

BB StdDev

CALCULATION

Zeitraumen

Warten Sie auf die Zeitr Rahmenschließung

Standar...

- None
- SMA
- SMA + Bollinger Bands
- EMA
- SMMA (RMA)
- WMA
- VWMA

