

Bewertungsrichtlinien von HeavytraderZ

Stand 01.09.2023

Samir Boyardan

Footprint & Volumen Händler



Andreas Wolf

Zyklus-Händler



Daniel Kaufmann

Quant-Volumen Händler



Lisa Prusch

Smart Money Händlerin



Bei der Bewertung von Finanzinstrumenten werden im HeavytraderZ Research gängige und anerkannte Verfahren der fundamentalen Analyse angewendet.

Folgende Methoden fließen in die Bewertung mit ein:

- Smart Money Analyse
- Zyklus Analyse
- Quant Volumen Analyse
- Footprint und Volumen Analyse

Zyklen und News-Trader – Bewertung zur Trade-Entscheidung

Zu den Bewertungsgrundlagen der Zyklen- und News-Trading-Analyse gehören im Wesentlichen die Intermarket-Analyse, die Technische Analyse und die Zyklen-Analyse. Im Folgenden werden die drei Komponenten im Einzelnen erklärt.

Intermarket-Analyse

Mit dieser Analyse-Methode wird ein übergeordneter Blick auf die internationalen Kapitalmärkte geworfen. Es wird unterstellt, dass diese alle untereinander in einer Beziehung stehen und sich gegenseitig beeinflussen, insbesondere bei größeren unerwarteten Ereignissen. Dies gilt für die vier Haupt-Assetklassen: Aktien, Anleihen, Währungen und Rohstoffe. So beeinflusst zum Beispiel die Zinsentwicklung die Entwicklung an den Aktienmärkten. Kapitalmärkte mit schwächeren Währungen können unter anderen mit einer besseren Aktienmarktentwicklung aufwarten und ein schwächerer USD für stärkere Rohstoffpreise sorgen. Aus historischen Datenreihen lassen sich diesbezüglich wiederkehrende Muster ableiten, die für die Zyklen-Analyse von Bedeutung ist

Technische Analyse

Ebenfalls aus historischen Daten von Kursen können mit Hilfe der technischen Analyse günstige Kauf- und Verkaufszeitpunkte für die vier genannten Asset-Klassen entwickelt werden. In der technischen Analyse spielen Unternehmensspezifische Daten keine Rolle, wohl aber die Marktbreite, die durch die Umsatzhöhe eines Basiswert erzielt wird. Zudem gibt es auch der Technischen Analyse bestimmte Kursmuster, die durch Zuhilfenahme von statistisch, quantitativen eine Kauf- oder Verkaufsentscheidung aus zyklischer Sicht unterstützen. Sie gehen einher mit saisonalen Entwicklungen, die sich in diesen Kursmustern analysieren lassen.

News-Analyse

Spezielle Nachrichtensituationen können in Einheit mit den beiden anderen genannten Analysemethoden eine Kauf- oder Verkaufsentscheidung beeinflussen. Insbesondere wenn es sich um Unternehmens- und/oder Branchenspezifische Nachrichten handelt, die einen Aktienkurs besonders stark und nachhaltig bewegen können. Das gilt für Indizes, Währungen und Rohstoffe vor allem bei geopolitischen Entscheidungen oder Veränderungen im gleichen Maße.

Zyklen-Analyse

<http://www.zyklische-aktienkursprognose.de/diplomarbeit-3-2-3-prinzipien.html>

Smart Money Trading – Bewertung zur Trade-Entscheidung

1. Wie ist der übergeordnete Trend?

Struktur oder auch der Trend hat den Ursprung im Orderflow. Grundsätzlich gilt:

Nachfrage > Angebot = Preis steigt

Nachfrage < Angebot = Preis sinkt

Nachfrage = Angebot = Keine signifikante Preisänderung (niedrige Volatilität)

Der Preis bewegt sich dabei in Wellen, aber ein Trend muss keine Trendlinien oder Channel beachten.

Jede Bewegung findet Ihre Begründung im Orderflow. Jemand der Kauft braucht Verkäufer

Ein Trend im Markt kriert höhere Hochs und höhere Tiefs und umgekehrt. Im Markt gibt es verschiedene Akteure. Person mit dem meisten Geld kann den Kurs bewegen. Struktur bildet sich in verschiedenen Formen. Alleine in verschiedenen Timeframes bildet sich Struktur unterschiedlich

Wichtig ist: Struktur bildet sich, ändert sich und hilft eine Richtung vorzugeben Regeln

1. Nur weil es einmal in die Richtung gegangen ist heißt es nicht, dass es zwingend so weiter geht
2. Strukturen kann sich hin und her bewegen
3. wird bestätigt mit einem Zusammenspiel mit Kerzen

Struktur hat min. 50% Korrektur

Im besten Fall stimmt der Bias/Richtung des kleineren TF mit dem größeren überein 2. Befinden wir uns in einer Liquiditätszone?

Liquiditätszonen sind Punkte, wo sich die Struktur dreht. Es gibt Demandzonen/ Nachfrage zone (untere) und Supplyzonen/ Angebotszone



Abbildung 1 Quelle: <https://www.flowbank.com/hs-fs/hubfs/supply%20and%20demand%20zone.jpg?width=591&name=supply%20and%20demand%20zone.jpg>

Über jedem Hoch/ Tief liegen StopLosses. Liquidität wird rausgenommen in dem der Preis höher oder tiefer pusht. (Treibstoff)

Nachfragezone (demand) Nachfrage übertrifft Angebot = Preis nach oben

Angebotszone (supply) Angebot übertrifft nachfrage = Preis nach unten

Zonen formen vor dem entsprechenden Trend

Warten auf die entsprechende Bestätigung, verschiedene Zonen können sich in verschiedenen TF formen

2nd hit in Zone = Bestätigung

Die Zonen bilden sich, wenn der Preis sich in Wellen bewegt durch eine bestimmte Kerzenformation.

Diese besteht aus zwei Kerzen. Bei einer Nachfragezone bildet sich eine kleine rote Kerze mit einer größeren Roten Kerze und bei Angebotszonen umgekehrt.

3. Wo ist das Fibonacci-Korrektur Level?

Die bedeutendsten Level des Fibonacci Indikators sind 23,6 %, 38,2 %, 50 %, 61,8 % und 78,6 %. Diese Prozentsätze repräsentieren mögliche Kursreaktionspunkte, an denen

Angebot und Nachfrage aufeinandertreffen und die Preise auf ihrem Weg zurückkehren oder abprallen können.



Abbildung 2: Fibonacci, Quelle: https://libertex.com/sites/default/files/inline-images/fibonacci_1.jpg

4. Wyckoff

Ist eine umfangreiche Strategie/ Prinzip aus 1930, um aus einer 7/10 Trade-Idee eine 10/10 zu machen.

Mischung aus Struktur, Supply/Demand, Manipulation und Liquidität

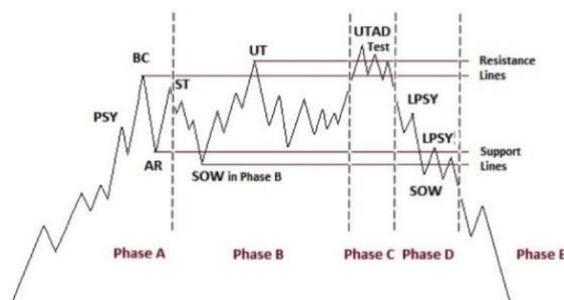
Wyckoff folgt 3 Gesetzen:

Angebot und Nachfrage

Ursache und Wirkung (Akkumulation aufwärts, Distribution abwärts) Aufwand und Ergebnis

Akkumulationsbereich und Distribution -- Wyckoff Schematic zur Abschwächung der Zone

Abbildung 3 Distribution, Quelle: <https://img.phemex.com/wp-content/uploads/2020/12/29093206/Wyckoff-Distribution-.jpg>



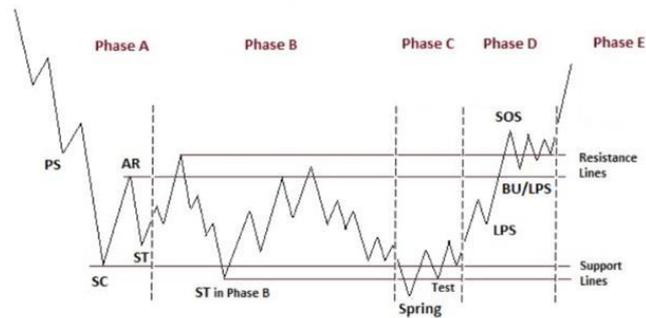


Abbildung 4: Accumulation, Quelle: <https://img.phemex.com/wp-content/uploads/2020/12/15105121/wyckoff-accumulation.png>

Volumen im Trading / Footprint

Das **Volumen Trading ist eine professionelle Strategie** für den Handel mit Finanzinstrumenten. Der Handelsvolumen Indikator soll dafür benutzt werden, um einen tieferen und realeren Einblick in den Markt zu bekommen. In den meisten Fällen wird er von speziellen Analyseprogrammen genutzt, um den Investoren wichtige Kaufs- und Verkaufsprognosen zu bieten.

Um das **Handelsvolumen zu bestimmen**, werden den Investoren meistens einige weiterführende Informationen angeboten:

- **Orderbook**
Mit dem Orderbook kann der Volumen Trader erkennen, wie hoch das Angebot und die Nachfrage auf dem Finanzmarkt in verschiedenen Preisebenen liegt.
- **Volume Profil**
Das Volume Profil wird meistens zusätzlich zum Preis Chart angeboten und zeigt das Handelsvolumen kumuliert zu einem bestimmten Preisniveau.
- **Market Profil**
Bei diesem Indikator handelt es sich um eine Kombination aus dem Preis, der Zeit und dem Handelsvolumen eines Finanzinstruments.
- **Footprint-Chart**
Der Footprint Chart ist eine Übertragung der T&S Liste und dem Preischart und zeigt die tatsächlich gehandelten aggressiven Markttransaktionen auf einem bestimmten Niveau an.

Quant Trading

Quants entwickeln Systeme, die ihnen helfen, die besten mathematischen Wahrscheinlichkeiten auf dem Markt zu finden. Es gibt zahlreiche verschiedene quantitative Handelssysteme, aber sie haben alle 4 Kernkomponenten: Strategie, Backtesting, Execution und Risikomanagement.