



Forestprofitrader
Signaalservice en opleidingen systeemtraden

Hallo,

Hierbij sturen we u de Forestprofitrader nieuwsbrief van juni 2010. We maken deze nieuwsbrief om u op de hoogte te houden van de ontwikkelingen van de signaaldienst van Forestprofitrader.

In deze nieuwsbrief wil ik u graag meenemen in de wereld van money/management en positionsizing.

We lezen vaak de stelling dat money/management het belangrijkste is bij traden en beleggen. In mijn opinie is dat maar gedeeltelijk juist, want er zijn weldegelijk nuances.

Succesvol traden of beleggen bestaat naar mijn mening uit drie factoren. 1. Je zult een verdomd goed tradingsysteem moeten hebben om op lange termijn succesvol te kunnen zijn. 2. Je zult inderdaad goed money/management moeten toepassen. 3. Je mindsetting moet in orde zijn.

De grootste vijand van de belegger is immers nog altijd de belegger zelf. Deze drie factoren zijn ook nog eens onlosmakelijk met elkaar verbonden. Je positieve mindsetting zou je misschien wel eens in de steek kunnen laten na een serie verlieslatende trades. Maar, als je die serie verlieslatende trades had uitgevoerd met een positionsize die niet te groot is, laat je positieve mindsetting je misschien toch niet in de steek. Zo zien we dat het één verband houdt met het ander en dat de zaken niet zo simpel zijn te stellen als soms lijkt.

Wij nemen per positie exact 2% risico van het op dat moment beschikbare handelskapitaal. Dat betekent dat we het verschil van de instapkoers tot onze stoplosskoers moeten omrekenen naar een zodanige positiegrootte, dat als de stoploss geraakt wordt we precies 2% hebben verloren. Dat doe je telkens voor iedere positie opnieuw. Het maakt met deze methode dus niet uit hoever weg je stoploss ligt, voor iedere transactie is het risico gelijk, n.l. 2%. Hierbij rekening houdend met correlatiefactoren.

Als we dus geld verdienen en ons handelskapitaal groeit mogen we volgens deze regels steeds groter handelen. Het procentuele risico per transactie blijft immers precies 2%. Zo ontstaat een groeicurve die exponentieel oploopt. Als je dit maar lang genoeg weet vol te houden gaat het kapitaal steeds sneller en steeds harder groeien.

Voorwaarde is wel dat je iedere positie van het systeem aangaat en exact de handels en money-management regels volgt.

Om dit in de praktijk te kunnen doen zul je van het systeem de historie moeten kennen en het je helemaal eigen hebben gemaakt. Deze voorwaarde is erg belangrijk vanwege het psychologische aspect wat om de hoek komt kijken als er echt geld op het spel staat. We doen namelijk de aanname dat de equitycurve zich in de toekomst net zo voortzet als hij in het verleden heeft gedaan. Je zult deze dus heel goed moeten (her)kennen zodat het emotioneel mogelijk is om door de moeilijke perioden heen te komen. Het "gedrag" van het systeem uit het verleden zal zich natuurlijk nooit exact gaan herhalen in de toekomst, maar we kunnen niet anders deze aanname aannemen. Hier zijn ook weer voorwaarden aan gesteld. Ik noem de theorie van deze voorwaarden de "margin of error" theorie. (zie ook het document op onze website RSI trader uitgesplitst).

Kennis van het historische gedrag van het systeem is met name van belang tijdens perioden van drawdown. Ieder handelssysteem kent deze perioden, ook die van ons. De ervaring leert dat erg veel - met name amateurs - die vol goede moed beginnen met handelen volgens de regels, er de brui aangeven als we een paar verlieslatende posities achter de rug hebben. Vervolgens missen deze handelaren de komende winstgevende posities en blijven dubbel gefrustreerd achter de feiten aanlopen. We hebben dit nu al zo vaak gezien. Dit is zo zonde. en vooral onnodig. Veelal is de oorzaak van dit "opgeven" te vinden in een verkeerd omgaan met positionsizing. Deze handelaren hebben namelijk zonder uitzondering boven hun "pijngrens" gehandeld.

De "Pijngrens" is een volkomen individueel gegeven. In ieder geval dient de handelaar er voor te zorgen dat de historische maximale drawdown ver onder zijn pijngrens ligt. Ga er gemakshalve maar vanuit dat toekomstige maximale drawdown groter wordt dan in het verleden het geval was. Zo blijf je waarschijnlijk in de werkelijkheid aan de veilige kant.

Al met al kunnen we de conclusie trekken dat het een nauw verband houdt met het ander. De prestaties van het gebruikte systeem en de gebruikte regels om een verantwoorde positiegrootte te bepalen zorgen dat de pijngrens van de handelaar gerespecteerd wordt. Dit alles is essentieel om de geweldige resultaten van een tradingsysteem zoals de RSI trader in de toekomst ook te kunnen behalen.

RSI trader vanaf 1 jan 2009 end of day toegepast op G7 valutas en indices



De stelling zoals we die in het begin neerzette heeft zoals u heeft kunnen lezen dus zeker nuances en vooral verbintenis met alle andere onderwerpen die van belang zijn bij succesvol traden. Met name het psychologische aspect komt hierbij naar boven.

Zo zien we dus dat we dachten terecht gekomen te zijn in de magische wereld van traden en beleggen, maar dat we in werkelijkheid terecht zijn gekomen in de wereld van "beslissingen nemen". En ook nog onder soms grote emotionele druk over mogelijk verlies. Dit kan de handelaar soms zelfs "verlammen" zodat er zelfs geen enkele beslissing genomen wordt.

Duidelijk is in ieder geval dat al uw mogelijke beleggingsbeslissingen vooraf volledig gedefinieerd moeten zijn. Zo voorkomt u dat u in een emotionele valkuil terecht komt. We komen dan vanzelf terecht in de wereld van systeemtraden. En dat is precies wat wij al jaren doen. Niet voor niets dus.....

Het leerproces van de gemiddeld belegger is statistisch gezien niet rooskleurig. Zoals met alles in het leven zal n.l. ook beleggen aangeleerd moeten worden. Helaas is dit voor velen een erg dure leerschool. We moeten immers leren van onze fouten, en in de beleggingswereld is hiermee geld gemoeid, zo simpel is het. Sommigen proberen het te leren met een demoaccount, maar wil je de echte pijn voelen zul je toch met echt en zuur verdiend geld moeten gaan starten. Vaak wordt het dan ineens een hele andere werkelijkheid.....

Daarom zeg ik altijd. Leer niet alleen van uw eigen fouten, maar vooral van die van anderen.....Dat is een stuk minder duur. Geld wat wordt besteed aan educatie en volgen van (goede) cursussen is meestal vele malen minder dan het geld wat verloren wordt door onwetendheid, of erger nog

"onbewuste onwetendheid".....Zorg dat u niet in deze valkuil stapt.

Wilt u meer weten over de RSI trader en dit zelf leren, geef u dan op voor een cursus "Succesvol traden". U leert dan ook veel meer over money-management en de psychologie welke om de hoek komt kijken bij succesvol traden. Kijk op de website www.forestprofittrader.com voor meer informatie. De eerste cursus vindt plaats op zaterdag 26 juni 2010. U bent van harte uitgenodigd.

Hartelijke groet en Happy trading,

Ron Wichgers

Uitschrijven voor mailing: stuur een mail naar info@forestprofittrader.com