RESEARCH · 5. NOVEMBER 2026

Warum ein Tagesziel das Ergebnis halbiert

Ein festes Ziel von 200 $ pro Tag halbiert den Jahresgewinn. Ein Zeitlimit für Verlusttrades kostet nichts und senkt den Drawdown. Der Unterschied liegt darin, welche Trades man abschneidet.

Viele Trader wollen von einem System dasselbe: verlässliche 200 $ pro Tag mit einem Micro-Kontrakt und keine langen Läufe. Der Simulator beantwortet beide Wünsche mit Zahlen.

Ein festes Gewinnziel von 200 $ pro Trade halbiert das Jahresergebnis, weil der Gewinn des Systems aus den wenigen Trades kommt, die bis zum nächsten Liquiditätslevel laufen, oft 300 bis 600 $ auf einem Micro. Wer sie bei 200 $ kappt, behält alle Verlierer und beschneidet die Gewinner.

«Schluss nach 200 $ für den Tag» ändert fast nichts: Nur 24 % der Handelstage erreichen überhaupt 200 $ mit einem Micro, und der Durchschnittstag macht 31 $. Die Regel greift selten, und wenn sie greift, nimmt sie einen zweiten Gewinner weg.

Ein Zeitlimit ist ein anderer Schnitt. Einen Trade zu schliessen, der nach sechzig Minuten noch unter dem Einstieg liegt, entfernt Trades, die nirgendwohin gingen; die Läufer bleiben, denn ein Läufer liegt dann über dem Einstieg. Ergebnis: fast derselbe Gewinn, Drawdown von 916 $ auf rund 800 $ in Version 2 und auf 573 $ in Version 3, längste Verlustserie von zehn auf acht.

Enges Nachziehen des Stops und Nachlegen von Kontrakten in einem guten Lauf wurden ebenfalls getestet: Beides verschlechtert das Verhältnis. Skalierung funktioniert nur über feste Grösse, zwei Micros ab etwa 3 000 $ Konto.

Die Lehre lässt sich verallgemeinern: nach Zeit schneiden, was nicht funktioniert, nicht nach Betrag, was funktioniert. Der Betrag, den man abschneiden würde, ist der, von dem das System lebt.

Backtest-Ergebnisse entstehen im Nachhinein und erfassen nicht jede Kosten- und Ausfallquelle der Live-Ausführung. Sie werden gezeigt, damit das System beurteilt werden kann, nicht um ein Ergebnis zu versprechen.