



Disclaimer:

Die Auswahl der Wertpapiere und sonstigen Finanzinstrumente, die veröffentlichten Informationen, insbesondere Daten, Studien, Kommentare, Einschätzungen, Empfehlungen, Trade-Ideen, Meinungen und Darstellungen dienen ausschließlich Informationszwecken und stellen weder eine Willenserklärung zum Abschluss eines Auskunftsvertrages noch eine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren oder Finanzinstrumenten dar. Daher ersetzen die hier vorliegenden Informationen keine anleger- und anlagegerechte Beratung.

Investition in Wertpapiere und Finanzinstrumente (vor allem Optionen) sind grundsätzlich mit Risiken, bis hin zum Totalverlust des eingesetzten Kapitals und darüber, verbunden.

Einschätzungen und Bewertungen reflektieren die Meinung des Verfassers im Zeitpunkt der Erstellung der Ausarbeitung. Alle Informationen wurden sorgfältig recherchiert und nach bestem Wissen und Gewissen erstellt. Eine Gewähr, Garantie oder Zusicherung für die Richtigkeit oder die Aktualität der hier zur Verfügung gestellten Informationen wird nicht übernommen. Allein verbindliche Grundlage sind die vom jeweiligen Anbieter zur Verfügung gestellten Produktinformationen. Der Verfasser behält sich vor, die Informationen jederzeit und ohne vorherige Ankündigung zu ändern oder zu ergänzen.

Jegliche Haftung und oder Inanspruchnahme von Regress wird vom Verfasser ausgeschlossen.

Der Verfasser kann zum Zeitpunkt der jeweiligen Veröffentlichung die Wertpapiere oder sonstigen Finanzinstrumente, über die informiert wird, halten und eventuell die Absicht haben, diese zu kaufen oder zu verkaufen. Hierdurch besteht die Möglichkeit eines Interessenkonflikts.

Diese PDF-Datei ist ausschließlich für Abonnenten von Income Trader vorgesehen. Eine Weiterleitung an Dritte ist untersagt.

Liebe Leserin, lieber Leser,

wir gehen den folgenden Trade ein:

Trade: Eröffnung KISS-Strangle

US-Ticker: RUT

Name: Russell 2000

Basispreis (Strike) des verkauften Puts: \$ 2500

Delta des verkauften Puts: ca. 3

Basispreis (Strike) des verkauften Calls: \$ 3215

Delta des verkauften Calls: ca. 3

Kontraktlaufzeit: 09.10.2026

Kontrakte: jeweils 1 (die Anzahl der Kontrakte bezieht sich auf eine Depotgröße von ca. \$ 25.000)

Prämie erhalten: ca. \$ 4,72- (\$ 472 je Kontrakt), nach dem aktuellen „Mid-Preis“.

Gültigkeit: GTC

Börse: Smart

Take-Profit: 75% (wird eingestellt, sobald der Order ausgeführt wurde)

Stopp (mental): 175 % (Erweiterbar ggf. auf 300%)

Hedge / „Marginbegrenzer“:

US-Ticker: SPX

Basispreis (Strike) der gekauften Puts: \$ 1800

Kontraktlaufzeit: 17.12.2026

Kontrakte: 2

Kurs: ca. \$ 0,25 bis \$ 0,30

ACHTUNG:

Achte auf die Margin-Auslastung deines Depots. Es macht für deine Depotgröße möglicherweise keinen Sinn, jeden Trade mitzumachen.

Liebe Grüße,

Das Team der Tradehelden

<https://tradehelden.com/income-trader>

Telegram-Gruppe: [Link](#)
[Track-Rekord](#)

Strategiebeschreibung: Statistischer Einkommenshandel mit Stillhalteroptionen

Strategieprofil

Die Strategie basiert auf einem statistischen Einkommensansatz mit dem gezielten Verkauf von Optionen („Stillhalterstrategie“). Der Fokus liegt nicht auf der Vorhersage kurzfristiger Marktbewegungen, sondern auf der systematischen Nutzung statistischer Wahrscheinlichkeiten, der Volatilitätsprämie und der langfristigen Aufwärtsdrift der Aktienmärkte.

Es handelt sich um eine High-Probability-Strategie, bei der bewusst eine hohe Trefferquote angestrebt wird. Dafür werden höhere Margin-Anforderungen akzeptiert, um im Gegenzug eine robuste Verlustbegrenzung und eine hohe Wahrscheinlichkeit erfolgreicher Trades zu erreichen.

Der Handel erfolgt über ein Margin-Depot mit Portfoliomargin, beispielsweise bei Interactive Brokers. Durch die Kombination verschiedener Indexoptionen wird die Kapitaleffizienz optimiert und die erforderliche Sicherheitsleistung reduziert.

Handelsansatz

Im Mittelpunkt stehen Stillhaltergeschäfte auf den Russell-2000-Index (RUT). Dabei kommen überwiegend Short Strangles und Iron Condors zum Einsatz. Diese Strategien profitieren vom Zeitwertverfall der Optionen und der Tatsache, dass ein Großteil der Optionen wertlos verfällt.

Ein besonderer Bestandteil des Ansatzes ist die Absicherung des Short Strangles durch den Kauf von langlaufenden Put-Optionen auf den S&P-500-Index (SPX). Diese Long Puts erfüllen zwei zentrale Funktionen:

Risikobegrenzung: Sie dienen als Schutz gegen außergewöhnlich starke Marktbewegungen und reduzieren das Verlustrisiko bei starken Kursrückgängen.

Marginoptimierung: Innerhalb eines Portfoliomargin-Systems können SPX-Long-Puts die erforderliche Margin für den RUT-Short-Strangle deutlich reduzieren, obwohl die Positionen auf unterschiedlichen Indizes aufgebaut sind.

Der SPX wird für die Absicherung bevorzugt, da er eine besonders breite Auswahl an Strike-Preisen und Laufzeiten bietet und dadurch eine präzisere Anpassung der Hedge-Position ermöglicht.

Auswahl der Positionen

Die Strategie nutzt gezielt die natürliche Aufwärtsdrift der Aktienmärkte. Die Short-Strikes werden so gewählt, dass sie ausreichend weit aus dem Geld liegen und gleichzeitig von der langfristigen positiven Entwicklung der Märkte profitieren.

Die Kombination aus statistisch günstigen Wahrscheinlichkeiten, angepasster Strike-Auswahl und gezieltem Hedging ermöglicht eine ausgewogene Balance zwischen laufenden Einnahmen und Risikokontrolle.

Handelsfrequenz und Timing

Neue Positionen werden in der Regel einmal pro Woche am Mittwoch eröffnet. Bei Wochen mit FOMC- bzw. FED-Meetings erfolgt die Positionierung üblicherweise erst am Donnerstag, um erhöhte Unsicherheiten durch geldpolitische Entscheidungen zu vermeiden.

Die durchschnittliche Haltedauer eines Trades beträgt etwa 16 Tage.

Die Zielgröße liegt bei etwa 200 USD Gewinn pro Kontrakt. Die Strategie erzielt dabei langfristig eine Rendite von ungefähr 10 % bezogen auf den durchschnittlich eingesetzten potenziellen Verlust eines Trades.

Risiko- und Kapitalmanagement

Die empfohlene Mindestgröße des Handelskontos beträgt 25.000 USD. Bei einem konservativen Risikoansatz von etwa 2 % Risikokapital pro Trade kann die Strategie strukturiert und kontrolliert umgesetzt werden.

Durch das integrierte Hedging-Konzept mit SPX-Puts sowie die Nutzung der Portfoliomargin wird versucht, das Verhältnis zwischen Kapitalbindung, Ertragspotenzial und Verlustbegrenzung zu optimieren.

Erwartungswerte und historische Eigenschaften

Die Strategie basiert auf langfristig getesteten statistischen Methoden. Historische Auswertungen zeigen eine durchschnittliche Trefferquote von etwa 85 %, wobei die genaue Entwicklung von Marktbedingungen, Volatilität und Ausführung abhängt.

Der Ansatz verfolgt nicht das Ziel, einzelne Marktbewegungen vorherzusagen, sondern nutzt wiederkehrende Marktmechanismen:

- den Zeitwertverlust von Optionen,
- statistisch günstige Wahrscheinlichkeiten,
- die langfristige Aufwärtsentwicklung der Aktienmärkte,
- sowie ein definiertes Risikomanagement.

Zusammenfassung

Die Strategie kombiniert einen systematischen Verkauf von Optionsprämien mit einem professionellen Risikomanagement. Durch die Verbindung von RUT-Short-Strangles, SPX-Long-Put-Hedges und Portfoliomargin entsteht ein effizienter Einkommensansatz, der auf langfristig bewährten statistischen Prinzipien basiert.

Der Schwerpunkt liegt auf einer hohen Eintrittswahrscheinlichkeit, kontrollierten Risiken und einer kontinuierlichen Ertragsgenerierung über viele Marktzyklen hinweg.

Unsere weiteren Publikationen, Dienstleistungen und Ressourcen



👤 Unsere Tradehelden-Akademie ist DER Treffpunkt für trading-gewandte Edelleute von Welt – wie kannst du da fehlen? Natürlich kannst du nicht: [Shop](#)

Unsere handverlesenen Börsendienste:

📦 [Börsendienst-Bundle](#)

☀️ [5-Star-Options](#)

💡 [Smarte Portfolios](#)

💰 [Earnings-Trader](#)

🎯 [Top-Pick](#)

🛡️ [Zero Hedge](#)

🚦 Sind das die epischsten Indikatoren der Welt? Wir denken doch, ja:

<https://ericludwig.de/indikatoren/>

<https://tradehelden.com/indikatoren>

🧠 Unser Trade-Lab:

- Wöchentliche Videos von Eric Ludwig oder Thomas Mangold

- Konkrete Trading-Setups und aktuelle Chancen an den Märkten
- Swing-, Momentum- und Breakout-Trades
- Optionsstrategien wie DualTent, Vertical Spreads, Zebra-Trades u.v.m.
- Cash Secured Puts nach klaren Kriterien
- Börsenampeln für Risiko-On / Risiko-Off Phasen
- Strategische Portfolios mit festen Regeln

<https://tradehelden.com/trade-lab>



Unsere YouTube-Kanäle:

[Optiontradingpal](#)

[Planet Options](#)

Impressum

Tradehelden, Schimmelgasse 10/2/11, 1030 Wien
E-Mail: support@tradehelden.com